

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资  
基金

二〇二三年年度报告

2023年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024年03月30日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介 .....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	15
§4 管理人报告 .....	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告 .....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	22
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	22
§5 托管人报告 .....	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	22
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	23
§6 审计报告 .....	23
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
§7 年度财务报告 .....	26
7.1 资产负债表.....	26

7.2 利润表.....	27
7.3 净资产变动表.....	28
7.4 报表附注.....	30
§8 投资组合报告.....	68
8.1 期末基金资产组合情况.....	68
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	68
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	91
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	93
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	93
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	93
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	94
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	94
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	94
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	95
8.12 市场中性策略执行情况.....	95
8.13 投资组合报告附注.....	95
§9 基金份额持有人信息.....	96
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	96
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	97
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	97
§10 开放式基金份额变动.....	98
§11 重大事件揭示.....	98
11.1 基金份额持有人大会决议.....	98
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	98
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	98
11.4 基金投资策略的改变.....	98
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	99
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	99
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	99
11.8 其他重大事件.....	101
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	102
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	102
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	103

§13 备查文件目录 ..... 103

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金		
基金简称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合		
基金主代码	008835		
基金运作方式	契约型开放式。本基金每个工作日开放申购，但本基金对每份基金份额设置三个月的最短持有期限。即：自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日三个月后的对应日的期间内，投资者不能提出赎回及转换转出申请；该日三个月后的对应日之后，投资者可以提出赎回及转换转出申请。若该日三个月后实际不存在对应日的，则顺延至下一日。		
基金合同生效日	2020年02月25日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	280,018,934.31份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E
下属分级基金的交易代码	008835	008836	020353
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	118,191,095.29份	161,826,924.61份	914.41份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金根据对市场的判断，采用“多空对冲”等投资策略，在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。本基金采用“自下而上”的数量化选股策略，根据市场状况及变化，不定期对模型进行调整，改进模型有效性，从而取得更高的收益。同时遵循数量化选股策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。本基金还将根据对证券市场走势的判断，适时利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险，并采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏

	差，捕捉绝对收益机会。债券投资策略方面，本基金基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。本基金的存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，利用股指期货等金融工具对冲系统性风险，与股票市场的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的实际收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊
	联系电话	021-20361818	010-66596688
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		裴长江	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街1号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

#### (1) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	214,616.14	19,414,646.39	80,720,517.42
本期利润	9,697,643.23	4,056,299.59	16,491,151.47
加权平均基金份额本期利润	0.0553	0.0061	0.0179
本期加权平均净值利润率	5.22%	0.58%	1.72%
本期基金份额净值增长率	5.24%	0.54%	3.56%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	10,809,343.36	20,078,119.46	32,460,880.48
期末可供分配基金份额利润	0.0915	0.0372	0.0316
期末基金资产净值	129,000,438.65	559,978,888.48	1,059,399,666.55
期末基金份额净值	1.0915	1.0372	1.0316
3.1.3 累计期末指标	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	9.15%	3.72%	3.16%

#### (2) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	901,264.81	2,945,545.35	-1,378,714.46
本期利润	6,597,734.51	-295,544.29	-21,339,210.13
加权平均基金份额本期利润	0.0459	-0.0007	-0.0603
本期加权平均净值利润率	4.37%	-0.07%	-5.80%



本期基金份额净值增长率	4.81%	0.15%	3.15%
3.1.2 期末数据和指标	2023年12月31日	2022年12月31日	2021年12月31日
期末可供分配利润	12,109,618.06	8,953,873.00	11,741,719.88
期末可供分配基金份额利润	0.0748	0.0255	0.0240
期末基金资产净值	173,936,542.67	360,532,405.92	501,076,299.66
期末基金份额净值	1.0748	1.0255	1.0240
3.1.3 累计期末指标	2023年12月31日	2022年12月31日	2021年12月31日
基金份额累计净值增长率	7.48%	2.55%	2.40%

(3) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	-9.22	—	—
本期利润	-2.01	—	—
加权平均基金份额本期利润	-0.0022	—	—
本期加权平均净值利润率	-0.20%	—	—
本期基金份额净值增长率	-0.20%	—	—
3.1.2 期末数据和指标	2023年12月31日	2022年12月31日	2021年12月31日
期末可供分配利润	83.58	—	—
期末可供分配基金份额利润	0.0914	—	—
期末基金资产净值	997.99	—	—
期末基金份额净值	1.0914	—	—
3.1.3 累计期末指标	2023年12月31日	2022年12月31日	2021年12月31日
基金份额累计净值增长率	-0.20%	—	—

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。本产品自2023年12月21日起增加E类份额。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### (1) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.54%	0.18%	1.13%	0.02%	-0.59%	0.16%
过去六个月	1.50%	0.17%	2.27%	0.01%	-0.77%	0.16%
过去一年	5.24%	0.18%	4.50%	0.01%	0.74%	0.17%
过去三年	9.58%	0.29%	13.50%	0.01%	-3.92%	0.28%
自基金合同生效起至今	9.15%	0.29%	17.32%	0.01%	-8.17%	0.28%

#### (2) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.44%	0.18%	1.13%	0.02%	-0.69%	0.16%
过去六个月	1.29%	0.17%	2.27%	0.01%	-0.98%	0.16%
过去一年	4.81%	0.18%	4.50%	0.01%	0.31%	0.17%
过去三年	8.27%	0.29%	13.50%	0.01%	-5.23%	0.28%
自基金合同生效起至今	7.48%	0.29%	17.32%	0.01%	-9.84%	0.28%

#### (3) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金分级生效日起至今	-0.20%	0.30%	0.12%	0.01%	-0.32%	0.29%

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

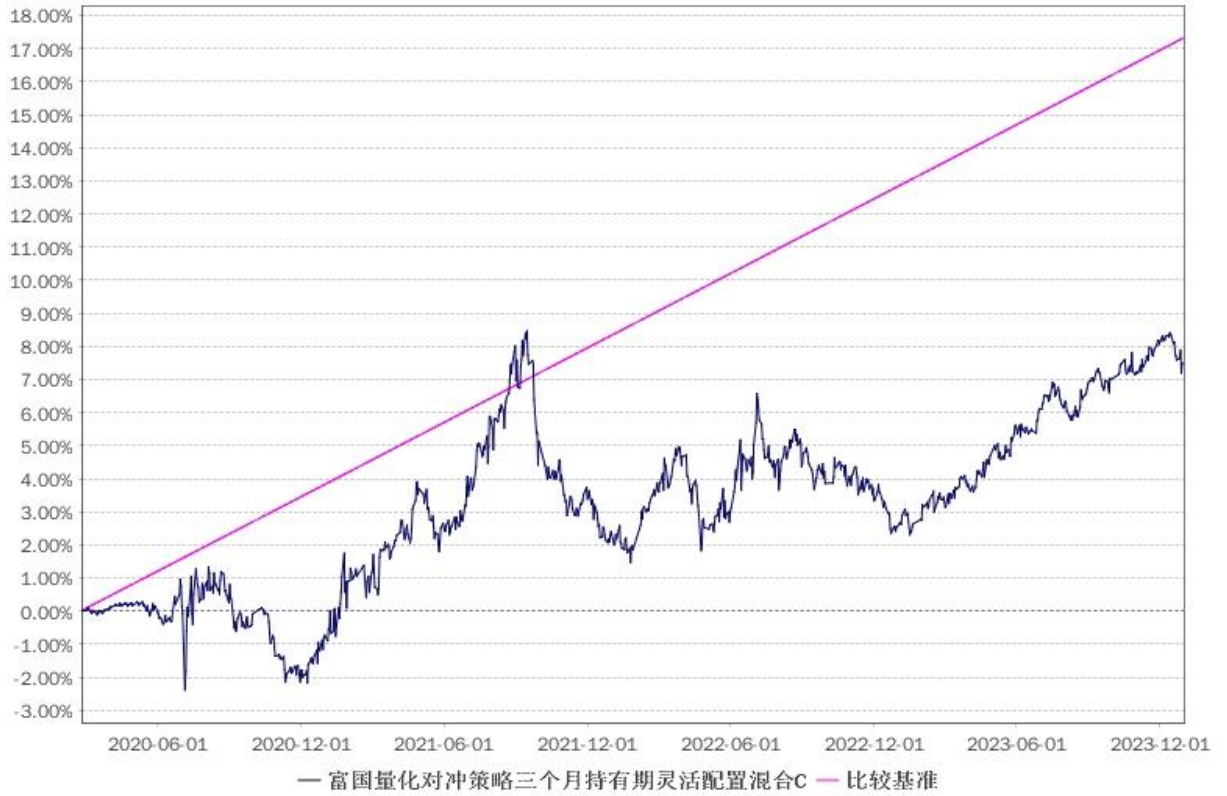
(1) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2020 年 2 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2020 年 2 月 25 日起至 2020 年 8 月 24 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

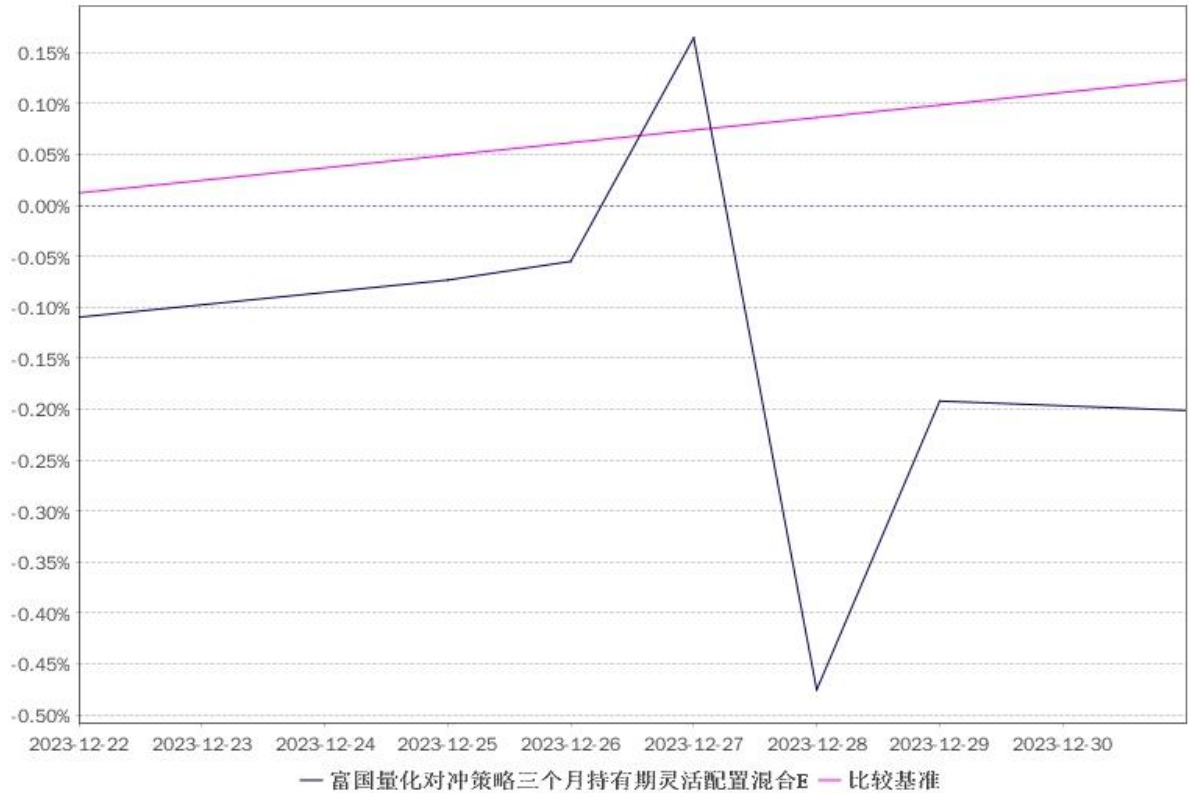
(2) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2020 年 2 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2020 年 2 月 25 日起至 2020 年 8 月 24 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(3) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

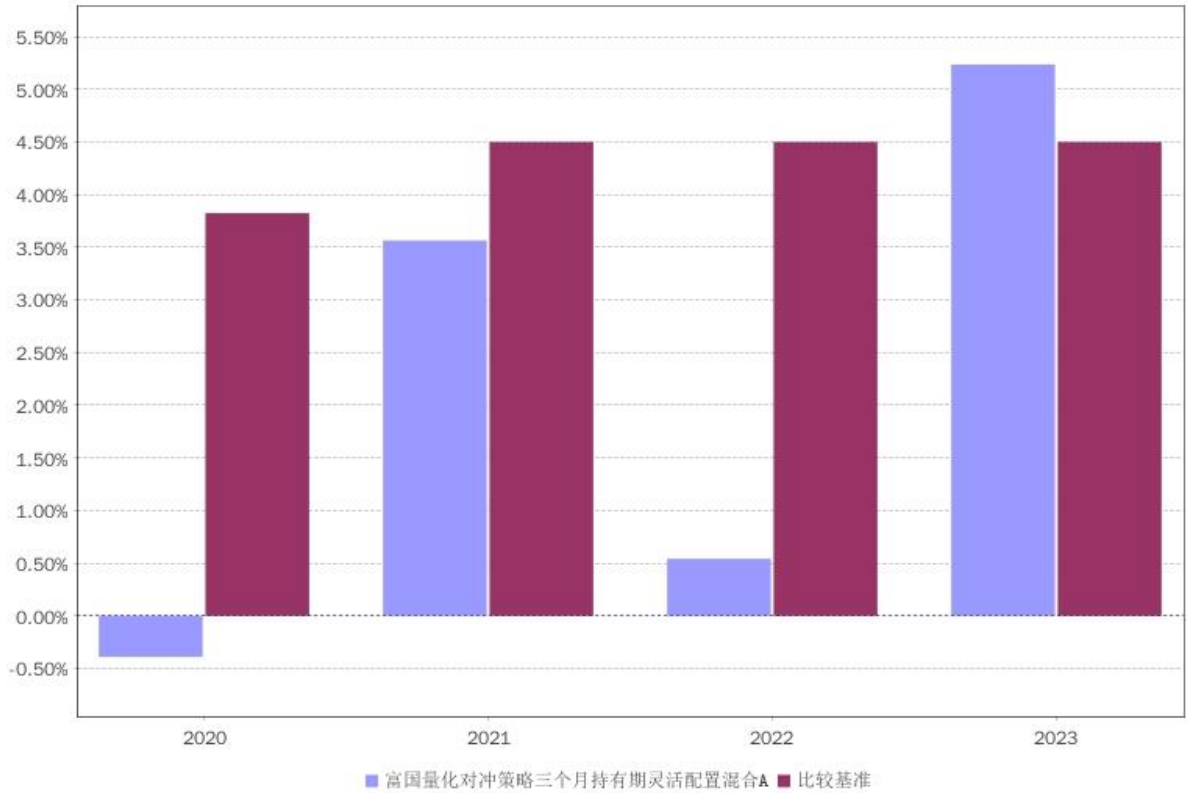


注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金自 2023 年 12 月 21 日起增加 E 类份额，相关数据按实际存续期计算。

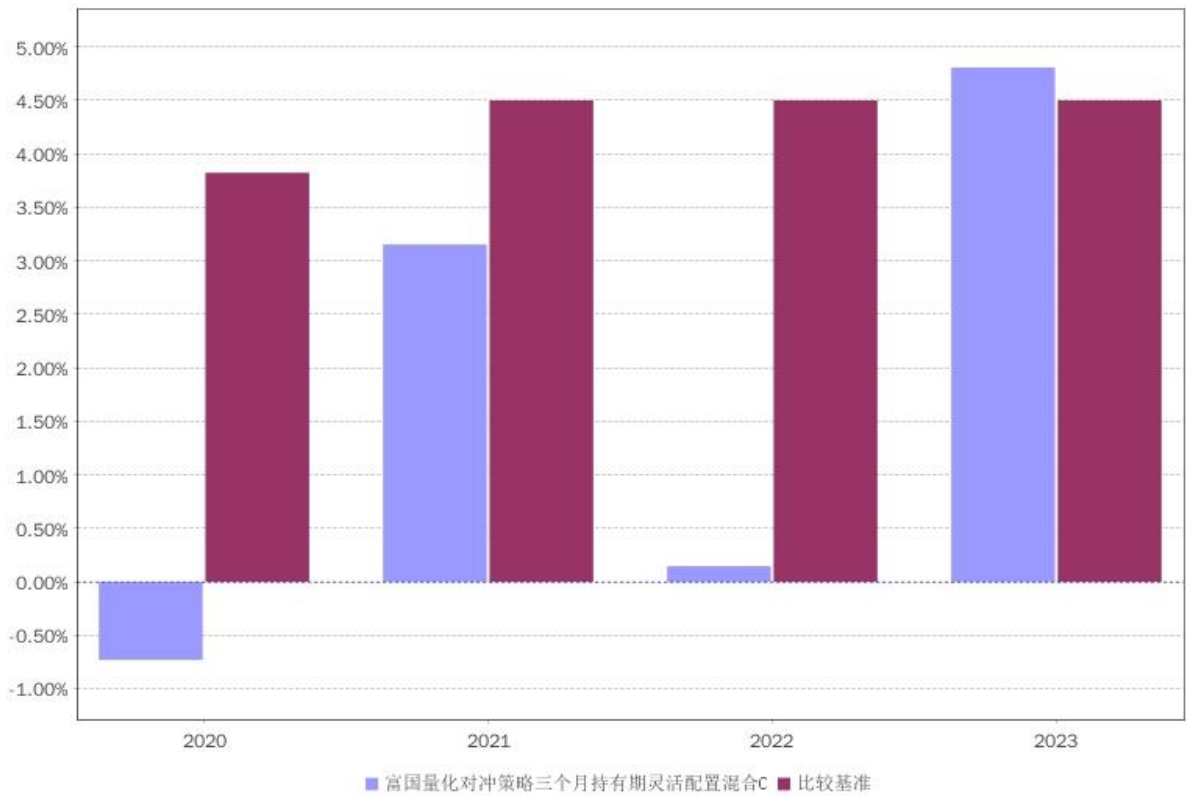
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



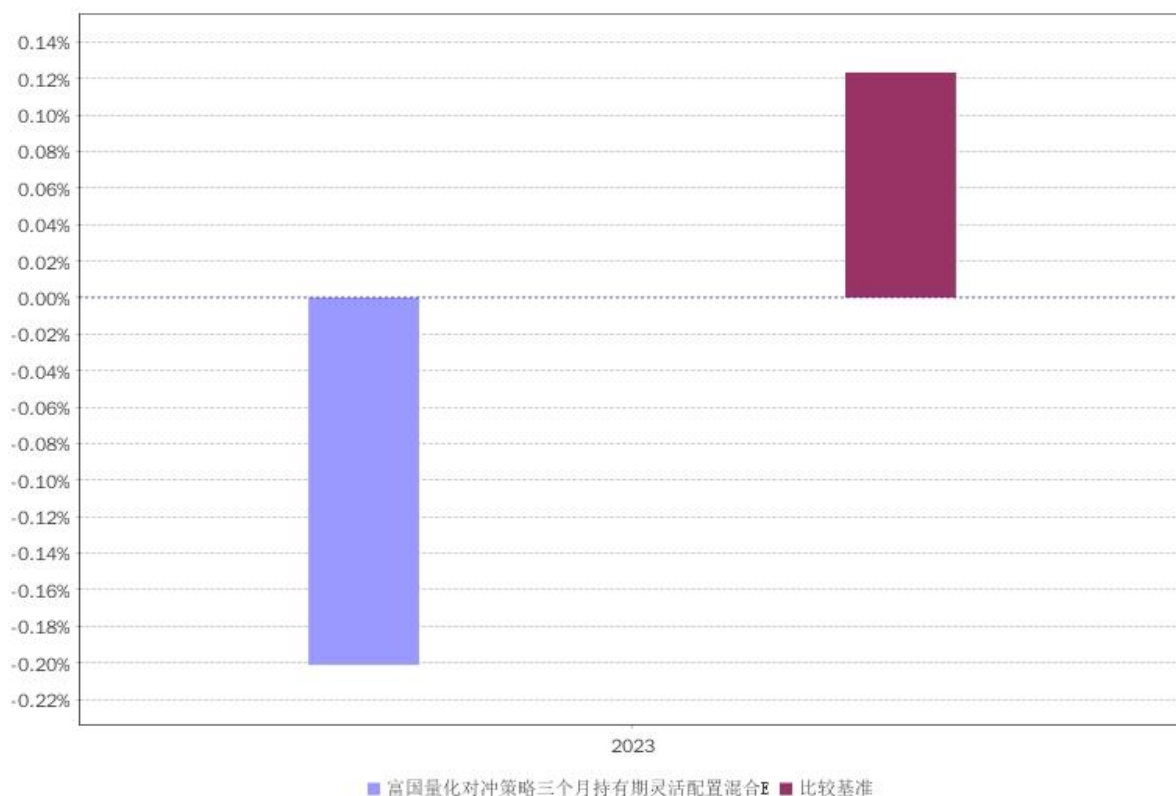
注：2020 年按实际存续期计算。

(2) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2020 年按实际存续期计算。

(3) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：E 类份额自 2023 年 12 月 22 日起有基金份额。2023 年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A

注：过往三年本基金未进行利润分配。

(2) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C

注：过往三年本基金未进行利润分配。

(3) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E

注：过往三年本基金未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批

成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 330 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金现任基金经理	2020-02-25	—	14	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数



					证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、

价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出

现 31 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2023 年初以来，随着主要城市疫情高峰过去，疫情对经济的冲击逐步减小，投资者对 2023 年经济复苏预期变动更加乐观，A 股迎来开门红。进入 3 月，由于两会政府工作报告公布的 GDP 增速目标低于市场预期，市场迎来一轮快速调整。4 月以来，由于 3 月 PMI 验证经济进一步向好，提振市场信心。在经济弱复苏，流动性宽裕的背景下，人工智能相关板块迎来加速上涨。石油化工、建筑等板块在中特估及一带一路等主题概念的驱动下也迎来靓丽表现。进入 5 月中旬，由于金融、通胀数据均回落，指向经济内生动能不强，复苏斜率放缓压制市场情绪，同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。2023 年下半年以来，由于国内经济增长压力仍然较大，二季度 GDP 数据不及预期，人民币贬值压力再度加大，市场出现调整。7 月末，随着政治局会议超预期释放利好，美联储如期加息 25bps 但表态偏鸽，指数强势回升。进入 8 月，由于 7 月多项经济金融数据超预期回落，政治局会议后政策出台密度和力度不及预期，同时美债收益率大幅攀升、美联储连续放鹰等外部冲击持续，北向资金大幅流出。进入 4 季度，由于公布的 9 月地产数据超预期下行、物价延续走低等引发市场担忧，资金面出现赎回等负反馈，沪指下破 3000 点。另外，美十年期国债突破新高、巴以冲突等海外风险持续压制全球风险资产。随着中央汇金持续增持 ETF，叠加万亿国债增发出台，市场悲观情绪缓解，走出底部反弹态势，沪指重回 3000 点以上。11 月，海外利率快速下行带动市场走出谷底，但国内经济复苏依然偏缓，市场波折震荡。12 月，海外抢跑降息预期，但国内经济复苏再次放缓叠加政策预期较低，市场创出年内新低。总体来看，2023 年上证综指下跌 3.7%，沪深 300 下跌 11.38%，创业板指下跌 19.41%，中证 500 指数下跌 7.42%。在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值 A 级为 1.0915 元，C 级为 1.0748 元，E 级为 1.0914 元；份额累计净值 A 级为 1.0915 元，C 级为 1.0748 元，E 级

为 1.0914 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 5.24%，C 级为 4.81%，E 级为-0.20%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 4.50%，C 级为 4.50%，E 级为 0.12%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望 2024 年，随着年初的快速调整，市场整体风险进一步释放，已具备较高的中长期配置价值。从政策层面看，呵护力度显著提升。其中，央行超预期降准，且下调支农支小再贷款、再贴现利率。房地产政策开始加码发力，“做好经营性物业贷款管理，满足房地产企业合理融资需求”，上海、苏州、广州等地购房政策进一步放开。从估值来看，1 月末市场估值处于历史低位，性价比凸显。沪深 300 指数股权风险溢价再次突破+2x 标准差，其估值分位数回落至近十年 13% 分位附近，创业板指已处于历史估值较低位。从中长期来看，市场具备较高的配置价值。

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告**

本基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，报告期内持续完善内控管理机制，全方位推动监察稽核工作深入开展。在基础性工作的基础上，2023 年度基金管理人重点开展的监察稽核工作包括以下方面：

##### **（一）持续推进制度流程建设，保障业务合规开展**

公司以建立重点业务内控制度体系，规范各业务部门内部管理为重点，持续强化公司内控管理与风险防范水平。报告期内，公司新增、修订多项内部管理制度，并以制度为基础相应完善业务流程。

##### **（二）深入进行新规学习，扎实推动新规落地**

2023 年度，公司从新规解读、制度建立、系统建设、流程改造等方面持续推进各项重要法律法规、监管要求的落地工作，并对落地情况开展专项检查，确保各项业务合法合规开展。

##### **（三）培育合规文化，全面提升员工合规意识**

为持续提高全员合规意识，公司对新员工、特定业务条线员工、全体员工开展不同侧重点的合规培训与宣导，结合多维度、多层次的合规谈话及合规考试，多管齐下全面提升员工的合规意识。

##### **（四）立足于合规，不断拓展风险管理职能**

报告期内，公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步根据系统升级迭代情况整合优化历史风控工具。公司持续强化合规风控培训工作，提升各部门主动合规的能力和意识。公司不断加强对新业务、新品种及整体风险控制能力的研究，保持对各类风险的敏感度，加强日常监测和定期风险评估，持续提升对于各类投资标的的风险管理水平。

#### （五）持续推进合规风控工作的系统化建设

2023 年公司结合自主研发和专业系统外采等多种途径，持续推动合规风控信息化建设。公司通过搭建、完善覆盖事前、事中、事后的风控系统工具体系，助力有效监测、识别投资组合运作过程中的各类风险，加强投资过程中各类风险的管理能力。在合规管理方面，新增或优化系统管理功能模块包括合规考试、合规谈话、采购及合同一体化管理流程等。通过系统建设，提升合规管理工作质效。

#### （六）全面加强员工行为管理

报告期内，公司持续加强对从业人员的行为管控，内容包括监控录像、电子邮件、电话录音抽查，特定员工通讯工具集中管理，员工证券投资申报管理及廉洁从业管理等方面。通过日常合规管理与定期事后检查相结合的方式，提升全员合规意识，加强员工行为管理，确保各项业务合规开展。

#### （七）扎实推进反洗钱工作

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、大额和可疑交易报告、客户资料和交易记录保存等反洗钱核心义务方面积极履职外，还通过重点专项工作等方式有序推动反洗钱工作深入开展。报告期内，主要重点工作包括开展机构洗钱风险评估、持续推动系统建设和数据治理工作、强化客户身份识别前端管控、多层次立体化文化宣贯等。

#### （八）深入开展内部审计，发挥第三道防线功能

公司围绕各条线各部门制度框架体系建立情况、法规落实情况及当年工作重点开展审计工作。通过基础风险点例行检查与法规落实情况、监管重点排查相结合的方式，深入开展内部审计检查并督导整改完善。报告期内，公司开展多项专项审计，涵盖投研、交易、销售、信息技术、反洗钱等各业务领域。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

### **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70015656_B149 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无

其他事项	无
其他信息	<p>富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程</p>



	<p>中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊   费泽旭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日

## § 7 年度财务报告

### 7.1 资产负债表

会计主体：富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	10,601,899.69	59,209,379.88
结算备付金	24,891,307.76	39,337,842.24
存出保证金	26,368,857.44	85,936,309.16
交易性金融资产	241,378,574.68	727,483,988.36
其中：股票投资	232,309,141.26	699,143,515.85
基金投资	—	—
债券投资	9,069,433.42	28,340,472.51
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	151,071.28	126,480.49
应收股利	—	—
应收申购款	459,653.73	11,000,621.39
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	303,851,364.58	923,094,621.52
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> <b>2023 年 12 月</b> <b>31 日</b>	<b>上年度末</b> <b>2022 年 12 月 31</b> <b>日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	179,963.37	220,792.40
应付管理人报酬	203,211.80	622,576.77
应付托管费	50,802.94	155,644.20
应付销售服务费	57,460.70	118,650.21
应付投资顾问费	—	—

应交税费	—	355,302.47
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	421,946.46	1,110,361.07
负债合计	913,385.27	2,583,327.12
<b>净资产：</b>		
实收基金	280,018,934.31	891,479,301.94
其他综合收益	—	—
未分配利润	22,919,045.00	29,031,992.46
净资产合计	302,937,979.31	920,511,294.40
负债和净资产总计	303,851,364.58	923,094,621.52

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0818 元，基金份额总额 280,018,934.31 份。其中：富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A 份额净值 1.0915 元，份额总额 118,191,095.29 份；富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C 份额净值 1.0748 元，份额总额 161,826,924.61 份；富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E 份额净值 1.0914 元，份额总额 914.41 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日)
<b>一、营业总收入</b>	20,536,906.74	17,743,573.83
1.利息收入	485,831.15	1,565,706.40
其中：存款利息收入	468,656.90	1,563,463.35
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	17,174.25	2,243.05
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,655,710.26	33,915,753.67
其中：股票投资收益	12,466,216.72	-167,510,801.09
基金投资收益	—	—
债券投资收益	206,497.19	1,502,049.05
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	-11,224,946.72	181,701,377.90
股利收益	3,207,943.07	18,223,127.81

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	—	—
其他投资收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	15,179,504.00	-18,599,436.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	215,861.33	861,550.20
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>4,241,531.01</b>	<b>13,982,818.53</b>
1. 管理人报酬	2,739,662.85	9,098,976.02
2. 托管费	684,915.78	2,274,744.07
3. 销售服务费	607,185.34	1,721,455.77
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	3,981.39
其中：卖出回购金融资产支出	—	3,981.39
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	0.12	655,713.14
8. 其他费用	209,766.92	227,948.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>16,295,375.73</b>	<b>3,760,755.30</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>16,295,375.73</b>	<b>3,760,755.30</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>16,295,375.73</b>	<b>3,760,755.30</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2023年01月01日至2023年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	891,479,301.94	29,031,992.46	920,511,294.40
二、本期期初净资产	891,479,301.94	29,031,992.46	920,511,294.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	611,460,367.63	6,112,947.46	617,573,315.09
（一）、综合收益总额	—	16,295,375.73	16,295,375.73
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	611,460,367.63	22,408,323.19	633,868,690.82
其中：1. 基金申购款	200,114,911	13,759,297.	213,874,209

	.75	91	.66
2. 基金赎回款	-	-	-
	811,575,279.38	36,167,621.10	847,742,900.48
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	280,018,934.31	22,919,045.00	302,937,979.31
项目	上年度可比期间 (2022年01月01日至2022年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,516,273,365.85	44,202,600.36	1,560,475,966.21
二、本期期初净资产	1,516,273,365.85	44,202,600.36	1,560,475,966.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-
	624,794,063.91	15,170,607.90	639,964,671.81
(一)、综合收益总额	-	3,760,755.30	3,760,755.30
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
	624,794,063.91	18,931,363.20	643,725,427.11
其中：1.基金申购款	689,932,562.60	27,477,092.53	717,409,655.13
2.基金赎回款	-	-	-
	1,314,726,626.51	46,408,455.73	1,361,135,082.24
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	891,479,301.94	29,031,992.46	920,511,294.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人  
基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2886号文《关于准予富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2020年2月25日正式生效，首次设立募集规模为2,990,813,376.70份基金份额，其中A类基金份额1,771,147,316.27份，C类基金份额1,219,666,060.43份。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于2023年12月19日发布的《富国基金管理有限公司关于富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金增加E类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自2023年12月21日起，本基金增加E类份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值与权益类多头头寸的价值的净风险敞口不超过基金资产净值的10%。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值、

其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。本基金投资于同业存单和银行存款的比例不超过基金资产的 20%。

每个交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额



和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得

不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### **7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含

票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红；若基金合同生效不满3个月，本基金可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的该类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类和 E 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

#### **7.4.4.12 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### **7.4.4.13 分部报告**

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问

题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2023年12月31日)	上年度末 (2022年12月31日)
活期存款	10,601,899.69	59,209,379.88
等于：本金	10,600,241.27	59,203,816.68
加：应计利息	1,658.42	5,563.20
减：坏账准备	—	—
定期存款	—	—
等于：本金	—	—
加：应计利息	—	—
减：坏账准备	—	—
其中：存款期限1个月	—	—



以内		
存款期限 1-3 个月	—	—
存款期限 3 个月以上	—	—
其他存款	—	—
等于：本金	—	—
加：应计利息	—	—
减：坏账准备	—	—
合计	10,601,899.69	59,209,379.88

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2023 年 12 月 31 日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	237,797,626.48	—	232,309,141.26	—5,488,485.22	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	8,977,742.00	82,813.42	9,069,433.42	8,878.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	8,977,742.00	82,813.42	9,069,433.42	8,878.00
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	246,775,368.48	82,813.42	241,378,574.68	—5,479,607.22	
项目	上年度末（2022 年 12 月 31 日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	730,671,678.72	—	699,143,515.85	—31,528,162.87	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	27,936,261.00	427,262.51	28,340,472.51	-23,051.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	27,936,261.00	427,262.51	28,340,472.51	-23,051.00
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	

合计	758,607,939.72	427,262.51	727,483,988.36	-31,551,213.87
----	----------------	------------	----------------	----------------

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

金额单位：人民币元

项目	本期末（2023年12月31日）			
	名义金额	公允价值		备注(成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
	215,768,680.00			
股指期货	-	-	-	-
	215,768,680.00			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
	215,768,680.00			
项目	上年度末（2022年12月31日）			
	名义金额	公允价值		备注(成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
	688,394,162.65			
股指期货	-	-	-	-
	688,394,162.65			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
	688,394,162.65			

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2403	IM2403	-1.00	-1,169,320.00	-24,200.00
IM2402	IM2402	-1.00	-1,172,960.00	-19,680.00

			00	
IM2401	IM2401	-6.00	7,065,600.00	12,160.00
IC2403	IC2403	-8.00	8,663,360.00	119,160.00
IC2401	IC2401	-28.00	30,446,080.00	342,440.00
IF2401	IF2401	-36.00	37,149,840.00	-608,940.00
IF2403	IF2403	-129.00	133,739,460.00	-3,458,880.00
合计				-3,637,940.00
减：可抵销期货暂收款				-3,637,940.00
净额				—

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	245.05	204.69
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	258,701.41	1,055,156.38
其中：交易所市场	258,701.41	1,055,156.38

银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提信息披露费	120,000.00	—
预提审计费	43,000.00	55,000.00
合计	421,946.46	1,110,361.07

#### 7.4.7.7 实收基金

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A:

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	539,900,769.02	539,900,769.02
本期申购	50,043,220.27	50,043,220.27
本期赎回（以“-”号填列）	-471,752,894.00	-471,752,894.00
本期末	118,191,095.29	118,191,095.29

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C:

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	351,578,532.92	351,578,532.92
本期申购	150,070,777.07	150,070,777.07
本期赎回（以“-”号填列）	-339,822,385.38	-339,822,385.38
本期末	161,826,924.61	161,826,924.61

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E:

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	—	—
本期申购	914.41	914.41
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	914.41	914.41

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	51,148,647.64	—	20,078,119.46
本期期初	51,148,647.64	31,070,528.18	20,078,119.46
本期利润	214,616.14	9,483,027.09	9,697,643.23
本期基金份额交易产生	—	14,103,913.35	-18,966,419.33

的变动数	33,070,332.68		
其中：基金申购款	5,178,108.31	-1,597,222.54	3,580,885.77
基金赎回款	38,248,440.99	15,701,135.89	-22,547,305.10
本期已分配利润	—	—	—
本期末	18,292,931.10	-7,483,587.74	10,809,343.36

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,030,277.57	20,076,404.57	8,953,873.00
本期期初	29,030,277.57	20,076,404.57	8,953,873.00
本期利润	901,264.81	5,696,469.70	6,597,734.51
本期基金份额交易产生的变动数	-7,675,472.91	4,233,483.46	-3,441,989.45
其中：基金申购款	16,371,609.92	-6,193,283.37	10,178,326.55
基金赎回款	24,047,082.83	10,426,766.83	-13,620,316.00
本期已分配利润	—	—	—
本期末	22,256,069.47	10,146,451.41	12,109,618.06

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期期初	—	—	—
本期利润	-9.22	7.21	-2.01
本期基金份额交易产生的变动数	150.70	-65.11	85.59
其中：基金申购款	150.70	-65.11	85.59
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	141.48	-57.90	83.58

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
活期存款利息收入	78,973.49	242,426.09
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	383,183.41	1,310,871.17

其他	6,500.00	10,166.09
合计	468,656.90	1,563,463.35

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
卖出股票成交总额	1,306,445,272.28	3,406,468,296.27
减：卖出股票成本总额	1,291,074,345.00	3,564,281,231.88
减：交易费用	2,904,710.56	9,697,865.48
买卖股票差价收入	12,466,216.72	-167,510,801.09

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
债券投资收益——利息收入	142,614.71	788,212.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	63,882.48	713,837.05
合计	206,497.19	1,502,049.05

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	36,320,191.64	87,688,130.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,658,911.00	85,162,028.00
减：应计利息总额	597,384.52	1,811,824.94
减：交易费用	13.64	440.14
买卖债券差价收入	63,882.48	713,837.05

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
股指期货投资收益	-11,224,946.72	181,701,377.90

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
股票投资产生的股利收益	3,207,943.07	18,223,127.81
其中：证券出借权益补偿收入	—	—
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	3,207,943.07	18,223,127.81

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
1. 交易性金融资产	26,071,606.65	-26,174,805.89
股票投资	26,039,677.65	-26,153,007.89
债券投资	31,929.00	-21,798.00
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	-10,892,102.65	7,575,369.45
权证投资	—	—
股指期货-套保卖出股指期货	-10,892,102.65	7,575,369.45
3. 其他	—	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—	—
合计	15,179,504.00	-18,599,436.44

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
基金赎回费收入	215,527.69	859,752.52
基金转换费收入	333.64	1,797.68
合计	215,861.33	861,550.20

#### 7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
审计费用	43,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	9,566.84	15,748.14
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.08	1,200.00
合计	209,766.92	227,948.14



## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的股东控制的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	123,877,545.19	5.91	700,328,476.15	10.97
申万宏源	34,936,329.21	1.67	798,133,314.38	12.50

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	7,520,826.75	22.60	18,455,505.05	55.47
申万宏源	—	—	133,585.79	0.40

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	90,160.57	5.94	40,691.30	15.73
申万宏源	25,424.93	1.68	11,283.40	4.36
关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	638,290.18	11.28	53,209.82	5.04
申万宏源	728,626.75	12.87	65,762.96	6.23

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,739,662.85	9,098,976.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	373,686.07	876,041.89

应支付基金管理人的净管理费	2,365,976.78	8,222,934.13
---------------	--------------	--------------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	684,915.78	2,274,744.07

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合E	合计
富国基金管理有限公司	—	126,590.45	—	126,590.45
海通证券股份有限公司	—	1.61	—	1.61
申万宏源证券有限公司	—	100.87	—	100.87

中国银行股份有限公司	—	14,265.56	—	14,265.56
合计	—	140,958.49	—	140,958.49

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E	合计
富国基金管理有限公司	—	373,373.82	—	373,373.82
申万宏源西部证券有限公司	—	88.22	—	88.22
申万宏源证券有限公司	—	10.80	—	10.80
中国银行股份有限公司	—	43,068.83	—	43,068.83
合计	—	416,541.67	—	416,541.67

注：自2023年12月21日起，本基金增加收取销售服务费的E类基金份额。本基金基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类基金份额不收取销售服务费。本基金C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提，E类基金份额销售服务费按前一日E类基金份额的基金资产净值的0.01%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E为该类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

#### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）			上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）		
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合E	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合E
基金合同生效日（2020年02月25日）持有的基金份额	—	—	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	—	—	—	—	—
期间申购/买入总份额	—	—	914.41	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	—	914.41	—	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	100.00%	—	—	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	10,601,899.69	78,973.49	59,209,379.88	242,426.09

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2023年01月01日至2023年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	301525	儒竞科技	IPO网下申购	545	54,265.65
海通证券股份有限公司	301568	思泰克	IPO网下申购	2,456	57,052.88
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	603193	润本股份	IPO网下申购	1,297	22,541.86
海通证券股份有限公司	688469	芯联集成	IPO网下申购	22,286	126,807.34
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO网下申购	3,944	364,662.24
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO网下申购	1,845	281,141.10
海通证券股份有限公司	688548	广钢气体	IPO网下申购	7,691	75,910.17

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO网下申购	8,184	1,353,328.34
海通证券股份有限公司	688271	联影医疗	IPO网下申购	6,113	675,054.92
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO网下申购	27,002	944,367.95
海通证券股份有限公司	688073	毕得医药	IPO网下申购	2,544	224,991.36
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688267	中触媒	IPO网下申购	3,390	142,751.21

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	—
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股限售	53.63	75.36	38	2,037.94	2,863.68	—
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新股限售	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	—
300904	威力传动	2023-08-02	6个月	新股限售	35.41	61.53	233	8,250.53	14,336.49	—
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	31.80	205	5,293.10	6,519.00	—
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	新股限售	28.88	34.59	196	5,660.48	6,779.64	—
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	50.85	139	5,129.10	7,068.15	—
301272	英华特	2023-07-06	6个月	新股限售	51.39	53.38	125	6,423.75	6,672.50	—
301329	信音电子	2023-07-05	6个月	新股限售	21.00	22.23	262	5,502.00	5,824.26	—
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月	新股限售	18.08	44.57	380	6,870.40	16,936.60	—
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月	新股限售	67.68	59.37	89	6,023.52	5,283.93	—
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	18.69	282	7,523.76	5,270.58	—
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	新股限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	—
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	新股限售	51.88	50.20	107	5,551.16	5,371.40	—
301421	波长光电	2023-08-16	6个月	新股限售	29.38	59.37	185	5,435.30	10,983.45	—
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	新股限售	37.96	30.39	170	6,453.20	5,166.30	—
301469	恒达新材	2023-08-10	6个月	新股限售	36.58	33.09	189	6,913.62	6,254.01	—
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	47.25	132	7,611.12	6,237.00	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	69.09	199	7,916.22	13,748.91	—
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股限售	23.97	20.89	185	4,434.45	3,864.65	—
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	新股限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	—
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	新股限售	16.82	26.68	416	6,997.12	11,098.88	—
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	新股限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	—

301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	新股限售	31.16	28.27	158	4,923.28	4,466.66	—
301516	中远通	2023-12-01	6个月	新股限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	—
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新股限售	26.87	43.69	132	3,546.84	5,767.08	—
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	新股限售	67.88	52.74	71	4,819.48	3,744.54	—
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	新股限售	99.57	81.46	55	5,476.35	4,480.30	—
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	新股限售	71.80	68.91	73	5,241.40	5,030.43	—
301533	威马农机	2023-08-07	6个月	新股限售	29.50	33.16	202	5,959.00	6,698.32	—
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	新股限售	37.56	43.57	128	4,807.68	5,576.96	—
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	—
301568	思泰克	2023-11-21	6个月	新股限售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	—
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	新股限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	—
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月	新股限售	16.80	31.19	147	2,469.60	4,584.93	—
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6个月	新股限售	58.08	57.81	35	2,032.80	2,023.35	—
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股限售	14.23	18.19	113	1,607.99	2,055.47	—
603193	润本股份	2023-10-09	6个月	新股限售	17.38	16.66	130	2,259.40	2,165.80	—
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股限售	21.29	21.53	129	2,746.41	2,777.37	—
603275	众辰科技	2023-08-16	6个月	新股限售	49.97	39.70	53	2,648.41	2,104.10	—
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股限售	25.73	24.88	79	2,032.67	1,965.52	—
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月	新股限售	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	—
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月	新股限售	9.87	12.75	770	7,599.90	9,817.50	—
688563	航材股份	2023-07-12	6个月	新股限售	78.99	60.49	151	11,927.49	9,133.99	—
688591	泰凌微	2023-08-18	6个月	新股限售	24.98	28.02	254	6,344.92	7,117.08	—
688592	司南导航	2023-08-07	6个月	新股限售	50.50	50.53	210	10,605.00	10,611.30	—
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	新股限售	8.66	11.06	622	5,386.52	6,879.32	—
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	74.14	112	6,160.00	8,303.68	—
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月	新股限售	73.33	51.00	129	9,459.57	6,579.00	—
688627	精智达	2023-07-11	6个月	新股限售	46.77	87.72	127	5,939.79	11,140.44	—
688638	誉辰智能	2023-07-04	6个月	新股限售	83.90	59.68	94	7,886.60	5,609.92	—
688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月	新股限售	46.80	36.07	142	6,645.60	5,121.94	—
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月	新股限售	15.18	21.43	266	4,037.88	5,700.38	—
688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月	新股限售	39.90	46.05	162	6,463.80	7,460.10	—
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月	新股限售	31.95	52.25	219	6,997.05	11,442.75	—
688653	康希通信	2023-11-10	6个月	新股限售	10.50	15.99	439	4,609.50	7,019.61	—
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月	新股限售	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	—
688702	盛科通信	2023-09-06	6个月	新股限售	42.66	48.18	134	5,716.44	6,456.12	—
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	新股限售	69.98	60.10	78	5,458.44	4,687.80	—
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	新股限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	—

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元



股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688337	普源精电	2023年12月25日	重大事项停牌	43.87	2024年01月09日	41.72	1,600.00	73,767.09	70,192.00	—

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	24,000.32
未评级	—	—
合计	—	24,000.32

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	10,601,899.69	—	—	—	—	—	10,601,899.69
结算备付金	24,891,307.76	—	—	—	—	—	24,891,307.76
存出保证金	40,063.04	—	—	—	—	26,328,794.40	26,368,857.44
交易性金融资产	509,714.52	—	8,559,718.90	—	—	232,309,141.26	241,378,574.68
应收清算款	—	—	—	—	—	151,071.28	151,071.28
应收申购款	—	—	—	—	—	459,653.73	459,653.73
资产总计	36,042,985.01	—	8,559,718.90	—	—	259,248,660.67	303,851,364.58
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	179,963.37	179,963.37
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	203,211.80	203,211.80
应付托管费	—	—	—	—	—	50,802.94	50,802.94
应付销售服务费	—	—	—	—	—	57,460.70	57,460.70
其他负债	—	—	—	—	—	421,946.46	421,946.46
负债总计	—	—	—	—	—	913,385.27	913,385.27
利率敏感度缺口	36,042,985.01	—	8,559,718.90	—	—	258,335,275.40	302,937,979.31
上年度末（2022年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	59,209,379.88	—	—	—	—	—	59,209,379.88
结算备付金	39,337,842.24	—	—	—	—	—	39,337,842.24

存出保证金	87,340.36	—	—	—	—	85,848,968.80	85,936,309.16
交易性金融资产	8,059,655.75	—	20,280,816.76	—	—	699,143,515.85	727,483,988.36
应收清算款	—	—	—	—	—	126,480.49	126,480.49
应收申购款	—	—	—	—	—	11,000,621.39	11,000,621.39
资产总计	106,694,218.23	—	20,280,816.76	—	—	796,119,586.53	923,094,621.52
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	220,792.40	220,792.40
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	622,576.77	622,576.77
应付托管费	—	—	—	—	—	155,644.20	155,644.20
应付销售服务费	—	—	—	—	—	118,650.21	118,650.21
应交税费	—	—	—	—	—	355,302.47	355,302.47
其他负债	—	—	—	—	—	1,110,361.07	1,110,361.07
负债总计	—	—	—	—	—	2,583,327.12	2,583,327.12
利率敏感度缺口	106,694,218.23	—	20,280,816.76	—	—	793,536,259.41	920,511,294.40

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	-4,375.72	-6,629.33
	2. 基准点利率减少 0.1%	4,375.72	6,629.33

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券

(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、衍生工具(股指期货、国债期货)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值与权益类多头头寸的价值的净风险敞口不超过基金资产净值的10%。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的0-95%,其中,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%。本基金投资于同业存单和银行存款的比例不超过基金资产的20%。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

金额单位:人民币元

项目	本期末(2023年12月31日)		上年度末(2022年12月31日)	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	232,309,141.26	76.69	699,143,515.85	75.95
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	9,069,433.42	2.99	28,340,472.51	3.08
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	241,378,574.68	79.68	727,483,988.36	79.03

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型(CAPM)对本基金的市场价格风险进



行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，市场基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 市场基准增加 1%	30,076.97	510,783.78
	2. 市场基准减少 1%	-30,076.97	-510,783.78

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2023年12月31日)	上年度末 (2022年12月31日)
第一层次	231,826,218.49	695,905,291.19
第二层次	9,139,625.42	29,280,447.91
第三层次	412,730.77	2,298,249.26
合计	241,378,574.68	727,483,988.36

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	2,298,249.26	2,298,249.26
当期购买	—	873,595.40	873,595.40
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	3,801,942.70	3,801,942.70
当期利得或损失总额	—	1,042,828.81	1,042,828.81
其中：计入损益的利得或损失	—	1,042,828.81	1,042,828.81
期末余额	—	412,730.77	412,730.77
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	84,498.59	84,498.59
项目	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	1,388,343.06	1,388,343.06
当期购买	—	1,917,948.29	1,917,948.29
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	1,198,799.09	1,198,799.09

当期利得或损失总额	—	190,757.00	190,757.00
其中：计入损益的利得或损失	—	190,757.00	190,757.00
期末余额	—	2,298,249.26	2,298,249.26
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	380,300.97	380,300.97

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	412,730.77	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1855-2.1752	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	2,298,249.26	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2127-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	232,309,141.26	76.45
	其中：股票	232,309,141.26	76.45
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,069,433.42	2.98
	其中：债券	9,069,433.42	2.98
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	35,493,207.45	11.68
8	其他各项资产	26,979,582.45	8.88
9	合计	303,851,364.58	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	144,130.00	0.05
B	采矿业	8,445,959.00	2.79
C	制造业	140,698,536.25	46.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,573,749.00	1.84
E	建筑业	1,623,880.20	0.54
F	批发和零售业	4,017,351.48	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	6,247,876.00	2.06
H	住宿和餐饮业	64,042.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,573,729.38	5.80
J	金融业	39,415,913.00	13.01
K	房地产业	2,467,351.35	0.81

L	租赁和商务服务业	2,024,004.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	769,120.60	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	151,318.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	106,896.00	0.04
Q	卫生和社会工作	63,450.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	1,537,709.00	0.51
S	综合	1,384,126.00	0.46
	合计	232,309,141.26	76.69

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,489	12,926,014.00	4.27
2	000725	京东方A	1,175,700	4,585,230.00	1.51
3	300750	宁德时代	26,000	4,244,760.00	1.40
4	000100	TCL 科技	848,440	3,648,292.00	1.20
5	000338	潍柴动力	261,385	3,567,905.25	1.18
6	601328	交通银行	594,600	3,413,004.00	1.13
7	600406	国电南瑞	138,300	3,086,856.00	1.02
8	002475	立讯精密	86,328	2,973,999.60	0.98
9	601398	工商银行	620,800	2,967,424.00	0.98
10	600660	福耀玻璃	75,200	2,811,728.00	0.93
11	000651	格力电器	86,000	2,766,620.00	0.91
12	600016	民生银行	737,800	2,759,372.00	0.91
13	600276	恒瑞医药	57,310	2,592,131.30	0.86
14	600887	伊利股份	91,783	2,455,195.25	0.81
15	601766	中国中车	461,800	2,429,068.00	0.80
16	002001	新 和 成	139,800	2,371,008.00	0.78
17	601318	中国平安	57,971	2,336,231.30	0.77
18	600015	华夏银行	392,600	2,206,412.00	0.73
19	000157	中联重科	336,000	2,194,080.00	0.72
20	002252	上海莱士	273,100	2,184,800.00	0.72
21	600999	招商证券	158,700	2,164,668.00	0.71
22	603993	洛阳钼业	408,900	2,126,280.00	0.70
23	601816	京沪高铁	428,800	2,109,696.00	0.70
24	601169	北京银行	464,600	2,104,638.00	0.69
25	600900	长江电力	84,100	1,962,894.00	0.65
26	002600	领益智造	280,000	1,892,800.00	0.62
27	002736	国信证券	218,200	1,863,428.00	0.62
28	601319	中国人保	371,300	1,797,092.00	0.59

29	000039	中集集团	224,700	1,718,955.00	0.57
30	601939	建设银行	263,300	1,714,083.00	0.57
31	601006	大秦铁路	228,500	1,647,485.00	0.54
32	000559	万向钱潮	307,800	1,597,482.00	0.53
33	600019	宝钢股份	263,800	1,564,334.00	0.52
34	300296	利亚德	260,013	1,560,078.00	0.51
35	002027	分众传媒	246,300	1,556,616.00	0.51
36	601211	国泰君安	102,900	1,531,152.00	0.51
37	000333	美的集团	27,078	1,479,271.14	0.49
38	601901	方正证券	179,000	1,442,740.00	0.48
39	000063	中兴通讯	51,500	1,363,720.00	0.45
40	600104	上汽集团	99,201	1,342,189.53	0.44
41	000009	中国宝安	113,900	1,337,186.00	0.44
42	600036	招商银行	47,900	1,332,578.00	0.44
43	688538	和辉光电	546,000	1,326,780.00	0.44
44	002128	电投能源	92,700	1,322,829.00	0.44
45	000895	双汇发展	49,000	1,308,790.00	0.43
46	000513	丽珠集团	37,300	1,305,873.00	0.43
47	000858	五粮液	9,230	1,295,061.30	0.43
48	601607	上海医药	77,400	1,294,902.00	0.43
49	601600	中国铝业	227,400	1,282,536.00	0.42
50	601728	中国电信	235,000	1,271,350.00	0.42
51	000630	铜陵有色	376,643	1,235,389.04	0.41
52	601818	光大银行	411,600	1,193,640.00	0.39
53	002841	视源股份	25,500	1,166,880.00	0.39
54	600637	东方明珠	153,600	1,155,072.00	0.38
55	600901	江苏金租	232,740	1,126,461.60	0.37
56	601229	上海银行	186,800	1,115,196.00	0.37
57	600690	海尔智家	52,192	1,096,032.00	0.36
58	601668	中国建筑	225,200	1,083,212.00	0.36
59	601985	中国核电	143,500	1,076,250.00	0.36
60	000538	云南白药	21,700	1,066,555.00	0.35
61	600998	九州通	151,948	1,065,155.48	0.35
62	600941	中国移动	10,700	1,064,436.00	0.35
63	002129	TCL中环	67,650	1,058,046.00	0.35
64	600760	中航沈飞	24,900	1,050,282.00	0.35
65	600177	雅戈尔	159,960	1,047,738.00	0.35
66	002410	广联达	55,000	942,700.00	0.31
67	688009	中国通号	214,389	939,023.82	0.31
68	002185	华天科技	110,100	938,052.00	0.31
69	601899	紫金矿业	72,900	908,334.00	0.30

70	002249	大洋电机	178,400	886,648.00	0.29
71	000937	冀中能源	124,100	886,074.00	0.29
72	002414	高德红外	120,800	881,840.00	0.29
73	600050	中国联通	182,200	798,036.00	0.26
74	600018	上港集团	152,600	747,740.00	0.25
75	600489	中金黄金	74,400	741,024.00	0.24
76	600886	国投电力	56,000	738,080.00	0.24
77	002304	洋河股份	6,700	736,330.00	0.24
78	600893	航发动力	18,900	706,482.00	0.23
79	600570	恒生电子	24,400	701,744.00	0.23
80	600875	东方电气	47,900	700,298.00	0.23
81	300124	汇川技术	10,900	688,226.00	0.23
82	600989	宝丰能源	46,300	683,851.00	0.23
83	300433	蓝思科技	51,800	683,760.00	0.23
84	300628	亿联网络	23,120	683,196.00	0.23
85	600885	宏发股份	24,700	682,708.00	0.23
86	600741	华域汽车	41,717	679,152.76	0.22
87	601231	环旭电子	44,500	672,395.00	0.22
88	600271	航天信息	62,600	666,064.00	0.22
89	600663	陆家嘴	75,400	659,750.00	0.22
90	002415	海康威视	19,000	659,680.00	0.22
91	601919	中远海控	68,100	652,398.00	0.22
92	600196	复星医药	26,000	650,780.00	0.21
93	688567	孚能科技	39,841	649,806.71	0.21
94	002065	东华软件	104,500	644,765.00	0.21
95	601877	正泰电器	29,900	643,149.00	0.21
96	002925	盈趣科技	32,400	630,828.00	0.21
97	600426	华鲁恒升	22,670	625,465.30	0.21
98	600312	平高电气	49,100	623,079.00	0.21
99	300627	华测导航	20,000	620,400.00	0.20
100	600380	健康元	48,900	607,827.00	0.20
101	000425	徐工机械	110,600	603,876.00	0.20
102	601311	骆驼股份	75,100	601,551.00	0.20
103	601360	三六零	66,700	600,967.00	0.20
104	002152	广电运通	49,000	600,740.00	0.20
105	002130	沃尔核材	79,300	598,715.00	0.20
106	000408	藏格矿业	23,533	596,326.22	0.20
107	688126	沪硅产业	33,503	580,271.96	0.19
108	600398	海澜之家	77,900	578,018.00	0.19
109	600383	金地集团	132,300	576,828.00	0.19
110	600918	中泰证券	83,900	575,554.00	0.19

111	600959	江苏有线	182,300	572,422.00	0.19
112	600183	生益科技	31,100	569,441.00	0.19
113	601998	中信银行	107,400	568,146.00	0.19
114	300014	亿纬锂能	13,300	561,260.00	0.19
115	603369	今世缘	11,500	560,625.00	0.19
116	600582	天地科技	100,700	547,808.00	0.18
117	002032	苏泊尔	10,300	546,003.00	0.18
118	002340	格林美	98,200	536,172.00	0.18
119	600332	白云山	18,600	531,960.00	0.18
120	000878	云南铜业	48,800	531,432.00	0.18
121	688819	天能股份	18,933	528,609.36	0.17
122	600584	长电科技	17,600	525,536.00	0.17
123	601138	工业富联	34,000	514,080.00	0.17
124	001965	招商公路	52,100	509,017.00	0.17
125	688661	和林微纳	10,700	490,274.00	0.16
126	601168	西部矿业	33,500	478,045.00	0.16
127	600030	中信证券	23,280	474,213.60	0.16
128	002938	鹏鼎控股	21,200	473,184.00	0.16
129	603228	景旺电子	20,900	471,504.00	0.16
130	002506	协鑫集成	163,600	448,264.00	0.15
131	600795	国电电力	107,700	448,032.00	0.15
132	600346	恒力石化	33,200	437,244.00	0.14
133	600517	国网英大	91,600	436,932.00	0.14
134	600704	物产中大	97,700	432,811.00	0.14
135	600219	南山铝业	146,700	431,298.00	0.14
136	688396	华润微	9,600	429,024.00	0.14
137	600438	通威股份	17,000	425,510.00	0.14
138	000938	紫光股份	21,900	423,765.00	0.14
139	000975	银泰黄金	28,200	423,000.00	0.14
140	600845	宝信软件	8,580	418,704.00	0.14
141	601377	兴业证券	70,900	416,183.00	0.14
142	601216	君正集团	110,900	414,766.00	0.14
143	601888	中国中免	4,900	410,081.00	0.14
144	003816	中国广核	131,300	408,343.00	0.13
145	000728	国元证券	59,100	403,653.00	0.13
146	000738	航发控制	20,200	401,980.00	0.13
147	002028	思源电气	7,700	400,708.00	0.13
148	601881	中国银河	33,100	398,855.00	0.13
149	600120	浙江东方	111,000	398,490.00	0.13
150	600352	浙江龙盛	46,500	390,600.00	0.13
151	601928	凤凰传媒	44,300	390,283.00	0.13



152	002007	华兰生物	17,400	385,062.00	0.13
153	300253	卫宁健康	53,300	383,227.00	0.13
154	600879	航天电子	49,600	382,416.00	0.13
155	300059	东方财富	27,100	380,484.00	0.13
156	300009	安科生物	36,500	373,030.00	0.12
157	603989	艾华集团	17,300	372,296.00	0.12
158	600812	华北制药	65,000	370,500.00	0.12
159	002422	科伦药业	12,700	368,935.00	0.12
160	601898	中煤能源	38,000	368,220.00	0.12
161	600967	内蒙一机	44,200	365,092.00	0.12
162	688707	振华新材	17,602	360,841.00	0.12
163	600909	华安证券	73,100	356,728.00	0.12
164	600737	中粮糖业	43,000	354,320.00	0.12
165	688100	威胜信息	11,979	346,432.68	0.11
166	300763	锦浪科技	4,900	342,510.00	0.11
167	600066	宇通客车	25,500	337,875.00	0.11
168	601658	邮储银行	75,600	328,860.00	0.11
169	002467	二六三	70,700	328,048.00	0.11
170	002601	龙佰集团	18,500	316,905.00	0.10
171	002405	四维图新	35,300	314,170.00	0.10
172	002078	太阳纸业	25,500	310,335.00	0.10
173	600905	三峡能源	71,000	310,270.00	0.10
174	601688	华泰证券	22,190	309,550.50	0.10
175	002673	西部证券	47,700	303,849.00	0.10
176	603233	大参林	12,100	301,290.00	0.10
177	600549	厦门钨业	17,200	295,496.00	0.10
178	603096	新经典	14,800	291,264.00	0.10
179	000783	长江证券	53,400	287,292.00	0.09
180	600515	海南机场	77,500	286,750.00	0.09
181	600252	中恒集团	113,100	283,881.00	0.09
182	603858	步长制药	16,600	282,366.00	0.09
183	688389	普门科技	12,500	281,375.00	0.09
184	600000	浦发银行	42,100	278,702.00	0.09
185	000563	陕国投A	91,200	277,248.00	0.09
186	600089	特变电工	19,990	275,862.00	0.09
187	600497	驰宏锌锗	53,400	269,670.00	0.09
188	002533	金杯电工	33,100	267,448.00	0.09
189	000156	华数传媒	36,200	266,794.00	0.09
190	000723	美锦能源	38,900	259,074.00	0.09
191	600350	山东高速	37,300	258,862.00	0.09
192	002171	楚江新材	34,600	258,808.00	0.09

193	600161	天坛生物	8,300	256,802.00	0.08
194	601108	财通证券	33,000	256,080.00	0.08
195	002390	信邦制药	55,600	246,864.00	0.08
196	603444	吉比特	1,000	245,120.00	0.08
197	600986	浙文互联	44,800	244,608.00	0.08
198	600007	中国国贸	12,600	244,188.00	0.08
199	600562	国睿科技	17,300	239,432.00	0.08
200	001696	宗申动力	36,100	239,343.00	0.08
201	300383	光环新网	24,500	238,140.00	0.08
202	688248	南网科技	9,300	232,221.00	0.08
203	600511	国药股份	8,100	231,822.00	0.08
204	000555	神州信息	20,314	229,345.06	0.08
205	002373	千方科技	20,400	228,684.00	0.08
206	688690	纳微科技	8,300	227,586.00	0.08
207	000623	吉林敖东	15,000	227,100.00	0.07
208	688235	百济神州	1,600	222,464.00	0.07
209	002131	利欧股份	97,100	221,388.00	0.07
210	002203	海亮股份	19,800	220,770.00	0.07
211	300017	网宿科技	28,100	220,585.00	0.07
212	002179	中航光电	5,640	219,960.00	0.07
213	603659	璞泰来	10,500	219,765.00	0.07
214	300395	菲利华	6,000	219,360.00	0.07
215	002563	森马服饰	38,000	219,260.00	0.07
216	601369	陕鼓动力	27,200	217,056.00	0.07
217	600572	康恩贝	42,600	215,130.00	0.07
218	300639	凯普生物	22,900	213,886.00	0.07
219	600702	舍得酒业	2,200	212,740.00	0.07
220	601288	农业银行	58,300	212,212.00	0.07
221	600096	云天化	13,600	212,160.00	0.07
222	600362	江西铜业	11,805	210,837.30	0.07
223	600556	天下秀	35,600	210,396.00	0.07
224	600919	江苏银行	31,200	208,728.00	0.07
225	601106	中国一重	71,900	207,072.00	0.07
226	603920	世运电路	11,300	206,564.00	0.07
227	600728	佳都科技	35,900	205,348.00	0.07
228	002541	鸿路钢构	9,400	204,262.00	0.07
229	000423	东阿阿胶	4,100	202,212.00	0.07
230	000650	仁和药业	30,400	201,552.00	0.07
231	605499	东鹏饮料	1,100	200,761.00	0.07
232	688116	天奈科技	6,819	198,023.76	0.07
233	600797	浙大网新	29,800	195,488.00	0.06

234	601088	中国神华	6,200	194,370.00	0.06
235	600309	万华化学	2,500	192,050.00	0.06
236	002916	深南电路	2,700	191,673.00	0.06
237	603883	老百姓	6,400	191,296.00	0.06
238	002085	万丰奥威	38,600	190,684.00	0.06
239	600028	中国石化	34,000	189,720.00	0.06
240	688668	鼎通科技	3,427	189,581.64	0.06
241	002968	新大正	14,900	186,399.00	0.06
242	688381	帝奥微	7,300	184,836.00	0.06
243	688599	天合光能	6,459	184,275.27	0.06
244	002421	达实智能	56,100	180,642.00	0.06
245	600029	南方航空	31,300	180,288.00	0.06
246	300760	迈瑞医疗	600	174,360.00	0.06
247	002180	纳思达	7,700	174,251.00	0.06
248	601989	中国重工	41,400	170,982.00	0.06
249	688387	信科移动	23,700	170,877.00	0.06
250	600566	济川药业	5,400	169,722.00	0.06
251	600588	用友网络	9,500	169,005.00	0.06
252	600988	赤峰黄金	11,900	166,719.00	0.06
253	601601	中国太保	7,000	166,460.00	0.05
254	300232	洲明科技	18,900	166,320.00	0.05
255	002459	晶澳科技	8,000	165,760.00	0.05
256	300451	创业慧康	25,200	165,060.00	0.05
257	601869	长飞光纤	5,800	159,268.00	0.05
258	000060	中金岭南	36,700	158,544.00	0.05
259	688779	长远锂科	21,700	158,410.00	0.05
260	000062	深圳华强	13,800	155,526.00	0.05
261	600718	东软集团	16,800	155,400.00	0.05
262	688105	诺唯赞	4,852	155,361.04	0.05
263	002049	紫光国微	2,300	155,135.00	0.05
264	601921	浙版传媒	20,100	153,564.00	0.05
265	002797	第一创业	26,300	152,803.00	0.05
266	600299	安迪苏	18,800	150,400.00	0.05
267	600764	中国海防	6,000	149,700.00	0.05
268	600061	国投资本	22,100	148,954.00	0.05
269	002429	兆驰股份	26,600	148,428.00	0.05
270	600580	卧龙电驱	12,600	147,798.00	0.05
271	600869	远东股份	33,400	146,626.00	0.05
272	603301	振德医疗	5,900	144,550.00	0.05
273	688139	海尔生物	3,567	144,534.84	0.05
274	601997	贵阳银行	28,100	144,434.00	0.05

275	002714	牧原股份	3,500	144,130.00	0.05
276	002537	海联金汇	21,600	143,856.00	0.05
277	000027	深圳能源	22,300	143,835.00	0.05
278	300470	中密控股	3,800	143,640.00	0.05
279	600011	华能国际	18,500	142,450.00	0.05
280	301095	广立微	1,900	141,987.00	0.05
281	600285	羚锐制药	8,100	138,591.00	0.05
282	600820	隧道股份	23,700	136,512.00	0.05
283	603939	益丰药房	3,400	136,136.00	0.04
284	601225	陕西煤业	6,500	135,785.00	0.04
285	300026	红日药业	31,700	134,408.00	0.04
286	600143	金发科技	16,200	129,438.00	0.04
287	002583	海能达	21,700	129,115.00	0.04
288	605166	聚合顺	13,000	128,960.00	0.04
289	000987	越秀资本	21,000	126,420.00	0.04
290	603328	依顿电子	15,300	124,695.00	0.04
291	603309	维力医疗	8,700	123,801.00	0.04
292	688008	澜起科技	2,100	123,396.00	0.04
293	600848	上海临港	12,147	122,077.35	0.04
294	300233	金城医药	7,300	121,618.00	0.04
295	000902	新洋丰	10,500	119,595.00	0.04
296	002396	星网锐捷	6,600	119,262.00	0.04
297	603236	移远通信	2,200	118,250.00	0.04
298	002030	达安基因	12,091	117,040.88	0.04
299	601618	中国中冶	38,200	116,892.00	0.04
300	000596	古井贡酒	500	116,400.00	0.04
301	601390	中国中铁	20,400	115,872.00	0.04
302	600038	中直股份	3,000	115,590.00	0.04
303	601222	林洋能源	17,900	114,381.00	0.04
304	600110	诺德股份	20,200	113,928.00	0.04
305	300463	迈克生物	7,500	113,025.00	0.04
306	688099	晶晨股份	1,800	112,734.00	0.04
307	000682	东方电子	14,000	112,700.00	0.04
308	300369	绿盟科技	11,700	110,331.00	0.04
309	300596	利安隆	3,720	109,963.20	0.04
310	600064	南京高科	18,200	109,928.00	0.04
311	600550	保变电气	22,500	109,800.00	0.04
312	002624	完美世界	9,200	108,928.00	0.04
313	600390	五矿资本	23,000	107,640.00	0.04
314	002607	中公教育	26,200	106,896.00	0.04
315	300366	创意信息	8,100	106,272.00	0.04

316	300303	聚飞光电	17,800	105,554.00	0.03
317	600225	卓朗科技	27,500	104,500.00	0.03
318	688390	固德威	800	104,464.00	0.03
319	603156	养元饮品	4,900	104,174.00	0.03
320	600958	东方证券	11,900	103,530.00	0.03
321	688107	安路科技	2,800	102,984.00	0.03
322	002677	浙江美大	10,000	101,100.00	0.03
323	600522	中天科技	8,000	99,920.00	0.03
324	600707	彩虹股份	14,700	99,225.00	0.03
325	600166	福田汽车	35,800	97,734.00	0.03
326	600037	歌华有线	12,600	97,398.00	0.03
327	601608	中信重工	24,400	94,184.00	0.03
328	002063	远光软件	15,100	93,318.00	0.03
329	603806	福斯特	3,800	92,226.00	0.03
330	300590	移为通信	7,600	91,276.00	0.03
331	601801	皖新传媒	13,100	91,045.00	0.03
332	300855	图南股份	2,940	88,788.00	0.03
333	000598	兴蓉环境	15,600	88,764.00	0.03
334	688133	泰坦科技	1,900	88,065.00	0.03
335	688262	国芯科技	3,000	88,020.00	0.03
336	002384	东山精密	4,800	87,264.00	0.03
337	600863	内蒙华电	22,200	86,580.00	0.03
338	600997	开滦股份	11,300	86,219.00	0.03
339	600699	均胜电子	4,800	86,208.00	0.03
340	603530	神马电力	4,100	85,034.00	0.03
341	603678	火炬电子	3,200	84,704.00	0.03
342	002581	未名医药	5,800	84,680.00	0.03
343	002266	浙富控股	24,900	84,660.00	0.03
344	002408	齐翔腾达	16,000	84,480.00	0.03
345	300887	谱尼测试	7,100	83,851.00	0.03
346	603916	苏博特	8,200	83,558.00	0.03
347	600498	烽火通信	5,000	83,200.00	0.03
348	600373	中文传媒	6,300	83,034.00	0.03
349	300900	广联航空	3,300	81,444.00	0.03
350	000958	电投产融	20,600	81,164.00	0.03
351	002258	利尔化学	6,700	80,199.00	0.03
352	600761	安徽合力	4,400	80,124.00	0.03
353	002913	奥士康	2,600	79,690.00	0.03
354	002332	仙琚制药	6,200	79,174.00	0.03
355	000012	南玻A	14,100	78,537.00	0.03
356	002202	金风科技	9,800	78,400.00	0.03

357	000876	新希望	8,200	76,424.00	0.03
358	002745	木林森	8,800	76,208.00	0.03
359	000893	亚钾国际	2,900	76,096.00	0.03
360	600266	城建发展	15,700	75,988.00	0.03
361	002602	世纪华通	14,600	75,336.00	0.02
362	600563	法拉电子	800	74,080.00	0.02
363	002212	天融信	7,500	73,350.00	0.02
364	000758	中色股份	16,200	72,900.00	0.02
365	300452	山河药辅	5,100	72,624.00	0.02
366	600208	新湖中宝	33,300	72,261.00	0.02
367	601098	中南传媒	7,000	71,190.00	0.02
368	688002	睿创微纳	1,600	70,752.00	0.02
369	601609	金田股份	10,400	70,408.00	0.02
370	688337	普源精电	1,600	70,192.00	0.02
371	300476	胜宏科技	3,700	68,265.00	0.02
372	603859	能科科技	1,800	67,914.00	0.02
373	688003	天准科技	1,800	67,536.00	0.02
374	603515	欧普照明	3,800	66,044.00	0.02
375	300217	东方电热	12,200	65,636.00	0.02
376	600711	盛屯矿业	15,000	65,100.00	0.02
377	601000	唐山港	18,600	65,100.00	0.02
378	688287	观典防务	6,500	64,155.00	0.02
379	600258	首旅酒店	4,100	64,042.00	0.02
380	601019	山东出版	6,800	63,784.00	0.02
381	000750	国海证券	17,800	63,012.00	0.02
382	600151	航天机电	9,200	60,628.00	0.02
383	300286	安科瑞	2,300	59,639.00	0.02
384	688800	瑞可达	1,477	59,345.86	0.02
385	600085	同仁堂	1,100	59,070.00	0.02
386	603707	健友股份	3,900	58,500.00	0.02
387	688160	步科股份	1,000	58,180.00	0.02
388	600039	四川路桥	7,680	57,523.20	0.02
389	601058	赛轮轮胎	4,800	56,400.00	0.02
390	600535	天士力	3,300	56,166.00	0.02
391	301011	华立科技	2,400	56,160.00	0.02
392	601162	天风证券	18,100	55,929.00	0.02
393	002074	国轩高科	2,600	55,900.00	0.02
394	300079	数码视讯	9,800	55,762.00	0.02
395	603757	大元泵业	2,300	55,752.00	0.02
396	601158	重庆水务	9,800	55,566.00	0.02
397	301090	华润材料	5,100	55,386.00	0.02

398	002223	鱼跃医疗	1,600	55,328.00	0.02
399	300352	北信源	11,600	55,100.00	0.02
400	300136	信维通信	2,300	54,280.00	0.02
401	600529	山东药玻	2,100	53,760.00	0.02
402	688056	莱伯泰科	1,600	53,616.00	0.02
403	603881	数据港	2,700	53,514.00	0.02
404	603639	海利尔	3,400	53,380.00	0.02
405	600409	三友化工	9,700	53,253.00	0.02
406	688225	亚信安全	2,900	53,186.00	0.02
407	600316	洪都航空	2,500	52,925.00	0.02
408	600906	财达证券	6,900	51,750.00	0.02
409	603368	柳药集团	2,700	51,084.00	0.02
410	603258	电魂网络	2,200	50,556.00	0.02
411	002149	西部材料	3,200	50,304.00	0.02
412	688552	航天南湖	2,100	49,329.00	0.02
413	600095	湘财股份	6,500	48,815.00	0.02
414	000589	贵州轮胎	7,900	48,348.00	0.02
415	605376	博迁新材	1,700	47,940.00	0.02
416	002670	国盛金控	5,100	47,532.00	0.02
417	603214	爱婴室	2,900	47,444.00	0.02
418	002859	洁美科技	1,900	47,405.00	0.02
419	002803	吉宏股份	2,300	47,288.00	0.02
420	300741	华宝股份	2,200	47,102.00	0.02
421	000933	神火股份	2,800	47,040.00	0.02
422	000877	天山股份	7,000	46,760.00	0.02
423	002484	江海股份	2,900	46,574.00	0.02
424	600480	凌云股份	5,100	46,461.00	0.02
425	603171	税友股份	1,300	45,994.00	0.02
426	600826	兰生股份	5,200	45,968.00	0.02
427	300594	朗进科技	2,200	45,936.00	0.02
428	002174	游族网络	4,000	45,840.00	0.02
429	300774	倍杰特	4,400	45,276.00	0.01
430	688521	芯原股份	900	44,964.00	0.01
431	002268	电科网安	2,000	44,920.00	0.01
432	600808	马钢股份	16,500	44,880.00	0.01
433	688121	卓然股份	2,198	44,465.54	0.01
434	688536	思瑞浦	300	43,890.00	0.01
435	300454	深信服	600	43,374.00	0.01
436	000969	安泰科技	4,800	43,152.00	0.01
437	600216	浙江医药	4,000	42,920.00	0.01
438	000901	航天科技	4,600	42,872.00	0.01

439	600977	中国电影	3,500	42,840.00	0.01
440	002558	巨人网络	3,800	42,332.00	0.01
441	688036	传音控股	300	41,520.00	0.01
442	000737	北方铜业	7,100	41,180.00	0.01
443	688403	汇成股份	3,900	41,145.00	0.01
444	600673	东阳光	5,600	41,048.00	0.01
445	601179	中国西电	8,300	40,919.00	0.01
446	002498	汉缆股份	10,200	40,800.00	0.01
447	000597	东北制药	7,500	40,125.00	0.01
448	000825	太钢不锈	10,700	39,911.00	0.01
449	002139	拓邦股份	4,000	39,040.00	0.01
450	603308	应流股份	2,700	38,691.00	0.01
451	000887	中鼎股份	3,100	38,347.00	0.01
452	300143	盈康生命	3,600	38,268.00	0.01
453	002488	金固股份	5,300	38,054.00	0.01
454	300371	汇中股份	3,100	37,789.00	0.01
455	000553	安道麦 A	5,400	37,476.00	0.01
456	002206	海利得	7,400	37,148.00	0.01
457	300327	中颖电子	1,600	36,480.00	0.01
458	688302	海创药业	700	36,449.00	0.01
459	301162	国能日新	700	36,316.00	0.01
460	000567	海德股份	3,400	36,142.00	0.01
461	601991	大唐发电	14,900	36,058.00	0.01
462	000950	重药控股	7,200	35,784.00	0.01
463	605358	立昂微	1,300	35,607.00	0.01
464	002649	博彦科技	2,900	35,583.00	0.01
465	300123	亚光科技	4,800	35,184.00	0.01
466	301302	华如科技	1,400	35,154.00	0.01
467	600131	国网信通	2,310	34,996.50	0.01
468	603985	恒润股份	1,400	34,790.00	0.01
469	300319	麦捷科技	3,600	34,704.00	0.01
470	300285	国瓷材料	1,500	34,680.00	0.01
471	600160	巨化股份	2,100	34,629.00	0.01
472	002807	江阴银行	9,700	34,435.00	0.01
473	688568	中科星图	700	34,342.00	0.01
474	600210	紫江企业	7,300	34,310.00	0.01
475	601186	中国铁建	4,500	34,245.00	0.01
476	000830	鲁西化工	3,400	34,102.00	0.01
477	601298	青岛港	5,500	33,990.00	0.01
478	000703	恒逸石化	5,000	33,600.00	0.01
479	002004	华邦健康	7,200	33,552.00	0.01



480	688261	东微半导	400	33,436.00	0.01
481	300039	上海凯宝	5,000	33,250.00	0.01
482	600703	三安光电	2,400	33,240.00	0.01
483	688158	优刻得	2,000	32,900.00	0.01
484	002617	露笑科技	5,300	32,860.00	0.01
485	600884	杉杉股份	2,400	32,688.00	0.01
486	002439	启明星辰	1,200	32,400.00	0.01
487	002064	华峰化学	4,800	32,208.00	0.01
488	300001	特锐德	1,600	32,160.00	0.01
489	688112	鼎阳科技	800	32,032.00	0.01
490	002097	山河智能	5,200	31,876.00	0.01
491	300497	富祥药业	3,400	31,824.00	0.01
492	002274	华昌化工	4,200	31,710.00	0.01
493	600486	扬农化工	500	31,560.00	0.01
494	688201	信安世纪	1,600	31,488.00	0.01
495	600583	海油工程	5,300	31,482.00	0.01
496	600481	双良节能	3,700	31,302.00	0.01
497	688170	德龙激光	800	31,240.00	0.01
498	300894	火星人	1,900	30,856.00	0.01
499	601166	兴业银行	1,900	30,799.00	0.01
500	600482	中国动力	1,700	30,617.00	0.01
501	603876	鼎胜新材	2,400	30,072.00	0.01
502	002646	天佑德酒	2,200	29,942.00	0.01
503	600377	宁沪高速	2,900	29,725.00	0.01
504	600888	新疆众和	4,100	29,684.00	0.01
505	002851	麦格米特	1,200	29,520.00	0.01
506	002241	歌尔股份	1,400	29,414.00	0.01
507	688102	斯瑞新材	2,200	29,018.00	0.01
508	300357	我武生物	1,000	29,000.00	0.01
509	603599	广信股份	1,980	28,710.00	0.01
510	688208	道通科技	1,200	28,500.00	0.01
511	002273	水晶光电	2,100	28,434.00	0.01
512	601212	白银有色	10,500	28,245.00	0.01
513	601857	中国石油	4,000	28,240.00	0.01
514	301181	标榜股份	1,000	28,230.00	0.01
515	300702	天宇股份	1,300	28,223.00	0.01
516	688388	嘉元科技	1,389	28,168.92	0.01
517	601399	国机重装	9,800	27,734.00	0.01
518	300416	苏试试验	1,500	27,555.00	0.01
519	000581	威孚高科	1,800	27,126.00	0.01
520	688032	禾迈股份	100	27,000.00	0.01

521	002399	海普瑞	2,300	26,979.00	0.01
522	300490	华自科技	2,300	26,703.00	0.01
523	689009	九号公司	900	26,694.00	0.01
524	601949	中国出版	3,300	26,664.00	0.01
525	688586	江航装备	2,400	26,616.00	0.01
526	688768	容知日新	721	26,540.01	0.01
527	688031	星环科技-U	400	26,028.00	0.01
528	300751	迈为股份	200	25,902.00	0.01
529	300382	斯莱克	2,600	25,818.00	0.01
530	600273	嘉化能源	3,000	25,770.00	0.01
531	002283	天润工业	4,300	25,155.00	0.01
532	600929	雪天盐业	3,900	25,155.00	0.01
533	600521	华海药业	1,700	24,939.00	0.01
534	600079	人福医药	1,000	24,860.00	0.01
535	600765	中航重机	1,300	24,843.00	0.01
536	003012	东鹏控股	3,000	24,750.00	0.01
537	002858	力盛体育	1,300	24,700.00	0.01
538	300271	华宇软件	3,000	24,570.00	0.01
539	688200	华峰测控	200	24,560.00	0.01
540	688348	昱能科技	200	24,476.00	0.01
541	688298	东方生物	682	24,388.32	0.01
542	600389	江山股份	1,400	24,360.00	0.01
543	600267	海正药业	2,600	24,336.00	0.01
544	601139	深圳燃气	3,500	24,115.00	0.01
545	603379	三美股份	700	23,800.00	0.01
546	300708	聚灿光电	2,100	23,688.00	0.01
547	000997	新大陆	1,200	23,532.00	0.01
548	002091	江苏国泰	3,000	23,490.00	0.01
549	603039	泛微网络	500	23,450.00	0.01
550	688733	壹石通	800	23,416.00	0.01
551	600996	贵广网络	2,600	23,296.00	0.01
552	000898	鞍钢股份	9,300	23,157.00	0.01
553	605399	晨光新材	1,700	23,052.00	0.01
554	603799	华友钴业	700	23,051.00	0.01
555	300168	万达信息	2,700	22,896.00	0.01
556	000932	华菱钢铁	4,400	22,660.00	0.01
557	300185	通裕重工	9,400	22,560.00	0.01
558	300457	赢合科技	1,200	22,128.00	0.01
559	603567	珍宝岛	1,800	21,888.00	0.01
560	600490	鹏欣资源	7,300	21,827.00	0.01

561	002532	天山铝业	3,600	21,636.00	0.01
562	603337	杰克股份	1,000	21,600.00	0.01
563	603010	万盛股份	2,000	21,580.00	0.01
564	600963	岳阳林纸	3,500	20,615.00	0.01
565	600348	华阳股份	2,100	20,496.00	0.01
566	600585	海螺水泥	900	20,304.00	0.01
567	688083	中望软件	200	19,908.00	0.01
568	601515	东峰集团	4,800	19,392.00	0.01
569	002014	永新股份	2,300	19,205.00	0.01
570	605007	五洲特纸	1,300	19,123.00	0.01
571	688239	航宇科技	400	19,108.00	0.01
572	600399	抚顺特钢	1,900	18,468.00	0.01
573	300080	易成新能	3,800	18,392.00	0.01
574	601375	中原证券	4,800	18,384.00	0.01
575	600392	盛和资源	1,800	18,324.00	0.01
576	600284	浦东建设	2,900	18,270.00	0.01
577	002195	岩山科技	5,900	18,113.00	0.01
578	688516	奥特维	200	18,100.00	0.01
579	002245	蔚蓝锂芯	2,100	17,892.00	0.01
580	300003	乐普医疗	1,100	17,776.00	0.01
581	300408	三环集团	600	17,670.00	0.01
582	300696	爱乐达	1,000	17,410.00	0.01
583	002801	微光股份	800	17,400.00	0.01
584	002307	北新路桥	4,100	17,384.00	0.01
585	688150	莱特光电	800	17,272.00	0.01
586	002645	华宏科技	1,500	16,950.00	0.01
587	301348	蓝箭电子	380	16,936.60	0.01
588	600500	中化国际	3,800	16,796.00	0.01
589	002749	国光股份	1,400	16,772.00	0.01
590	300775	三角防务	600	16,740.00	0.01
591	301220	亚香股份	500	16,525.00	0.01
592	300745	欣锐科技	600	16,302.00	0.01
593	000726	鲁泰A	2,500	16,200.00	0.01
594	601568	北元集团	3,400	16,116.00	0.01
595	603866	桃李面包	2,100	16,086.00	0.01
596	601678	滨化股份	3,800	15,998.00	0.01
597	688677	海泰新光	300	15,969.00	0.01
598	300070	碧水源	3,200	15,968.00	0.01
599	603601	再升科技	3,700	15,910.00	0.01
600	601198	东兴证券	1,900	15,637.00	0.01
601	002724	海洋王	1,900	15,618.00	0.01

602	301179	泽宇智能	600	15,570.00	0.01
603	603966	法兰泰克	1,900	15,542.00	0.01
604	300955	嘉亨家化	700	15,477.00	0.01
605	300685	艾德生物	700	15,386.00	0.01
606	300450	先导智能	600	15,360.00	0.01
607	688022	瀚川智能	700	15,358.00	0.01
608	002201	正威新材	2,100	15,183.00	0.01
609	002121	科陆电子	2,700	15,147.00	0.01
610	002768	国恩股份	700	14,994.00	0.00
611	002643	万润股份	900	14,931.00	0.00
612	603886	元祖股份	800	14,584.00	0.00
613	603556	海兴电力	500	14,515.00	0.00
614	000915	华特达因	500	14,480.00	0.00
615	300348	长亮科技	1,400	14,434.00	0.00
616	300904	威力传动	233	14,336.49	0.00
617	002048	宁波华翔	1,100	14,311.00	0.00
618	002516	旷达科技	2,900	14,297.00	0.00
619	300623	捷捷微电	900	14,283.00	0.00
620	002250	联化科技	2,000	14,260.00	0.00
621	002378	章源钨业	2,500	14,150.00	0.00
622	600577	精达股份	3,400	14,076.00	0.00
623	002557	洽洽食品	400	13,928.00	0.00
624	300323	华灿光电	1,900	13,908.00	0.00
625	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
626	301488	豪恩汽电	199	13,748.91	0.00
627	600461	洪城环境	1,500	13,710.00	0.00
628	603077	和邦生物	5,800	13,688.00	0.00
629	300349	金卡智能	1,100	13,662.00	0.00
630	603118	共进股份	1,500	13,440.00	0.00
631	688246	嘉和美康	400	13,368.00	0.00
632	300170	汉得信息	1,600	13,296.00	0.00
633	300870	欧陆通	300	13,281.00	0.00
634	603600	永艺股份	1,200	13,248.00	0.00
635	688680	海优新材	200	13,130.00	0.00
636	002500	山西证券	2,400	12,936.00	0.00
637	688045	必易微	300	12,849.00	0.00
638	002088	鲁阳节能	900	12,825.00	0.00
639	000019	深粮控股	1,700	12,818.00	0.00
640	002092	中泰化学	2,100	12,810.00	0.00
641	300378	鼎捷软件	600	12,786.00	0.00
642	603225	新凤鸣	900	12,780.00	0.00

643	600685	中船防务	500	12,775.00	0.00
644	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
645	002978	安宁股份	400	12,664.00	0.00
646	600755	厦门国贸	1,800	12,546.00	0.00
647	600817	宇通重工	1,300	12,480.00	0.00
648	688711	宏微科技	300	12,447.00	0.00
649	601555	东吴证券	1,700	12,427.00	0.00
650	300134	大富科技	1,200	12,384.00	0.00
651	300133	华策影视	2,100	12,327.00	0.00
652	600496	精工钢构	4,000	12,200.00	0.00
653	688078	龙软科技	300	12,096.00	0.00
654	300183	东软载波	800	12,072.00	0.00
655	600167	联美控股	2,100	11,907.00	0.00
656	600835	上海机电	1,000	11,870.00	0.00
657	600618	氯碱化工	1,300	11,830.00	0.00
658	002035	华帝股份	1,900	11,799.00	0.00
659	002651	利君股份	1,700	11,764.00	0.00
660	000683	远兴能源	2,000	11,740.00	0.00
661	300770	新媒股份	300	11,604.00	0.00
662	600623	华谊集团	1,800	11,592.00	0.00
663	300019	硅宝科技	700	11,557.00	0.00
664	300073	当升科技	300	11,460.00	0.00
665	688652	京仪装备	219	11,442.75	0.00
666	002044	美年健康	1,900	11,419.00	0.00
667	301087	可孚医疗	300	11,370.00	0.00
668	601126	四方股份	800	11,328.00	0.00
669	600751	海航科技	4,300	11,266.00	0.00
670	600063	皖维高新	2,600	11,180.00	0.00
671	688308	欧科亿	400	11,160.00	0.00
672	688627	精智达	127	11,140.44	0.00
673	000813	德展健康	3,400	11,118.00	0.00
674	301508	中机认检	416	11,098.88	0.00
675	601077	渝农商行	2,700	11,016.00	0.00
676	301421	波长光电	185	10,983.45	0.00
677	688232	新点软件	303	10,968.60	0.00
678	002023	海特高新	1,200	10,920.00	0.00
679	600531	豫光金铅	1,800	10,890.00	0.00
680	600548	深高速	1,200	10,788.00	0.00
681	000528	柳工	1,600	10,784.00	0.00
682	600955	维远股份	600	10,770.00	0.00
683	688676	金盘科技	300	10,749.00	0.00

684	688592	司南导航	210	10,611.30	0.00
685	002810	山东赫达	500	10,595.00	0.00
686	603040	新坐标	400	10,460.00	0.00
687	603936	博敏电子	1,000	10,440.00	0.00
688	603676	卫信康	1,000	10,430.00	0.00
689	688357	建龙微纳	200	10,338.00	0.00
690	600217	中再资环	2,300	10,074.00	0.00
691	688548	广钢气体	770	9,817.50	0.00
692	300671	富满微	300	9,699.00	0.00
693	600810	神马股份	1,300	9,672.00	0.00
694	600642	申能股份	1,500	9,630.00	0.00
695	300676	华大基因	200	9,600.00	0.00
696	002204	大连重工	2,100	9,597.00	0.00
697	300772	运达股份	900	9,576.00	0.00
698	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
699	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
700	603766	隆鑫通用	1,800	9,288.00	0.00
701	000503	国新健康	700	9,226.00	0.00
702	002932	明德生物	400	9,188.00	0.00
703	688563	航材股份	151	9,133.99	0.00
704	002314	南山控股	3,100	8,990.00	0.00
705	300777	中简科技	300	8,949.00	0.00
706	688209	英集芯	500	8,930.00	0.00
707	002922	伊戈尔	600	8,910.00	0.00
708	002226	江南化工	2,000	8,760.00	0.00
709	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
710	688206	概伦电子	400	8,720.00	0.00
711	600850	电科数字	400	8,700.00	0.00
712	300267	尔康制药	2,700	8,667.00	0.00
713	600691	阳煤化工	2,700	8,667.00	0.00
714	600459	贵研铂业	600	8,616.00	0.00
715	002125	湘潭电化	800	8,552.00	0.00
716	002641	公元股份	1,700	8,551.00	0.00
717	300575	中旗股份	1,100	8,404.00	0.00
718	001914	招商积余	700	8,372.00	0.00
719	688501	青达环保	500	8,365.00	0.00
720	688021	奥福环保	400	8,340.00	0.00
721	688603	天承科技	112	8,303.68	0.00
722	301047	义翘神州	100	8,240.00	0.00
723	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
724	300682	朗新集团	500	8,195.00	0.00

725	002791	坚朗五金	200	8,098.00	0.00
726	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
727	600169	太原重工	3,400	8,024.00	0.00
728	002706	良信股份	900	7,947.00	0.00
729	601908	京运通	1,700	7,769.00	0.00
730	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
731	600170	上海建工	3,300	7,722.00	0.00
732	600391	航发科技	400	7,648.00	0.00
733	600873	梅花生物	800	7,640.00	0.00
734	002003	伟星股份	700	7,595.00	0.00
735	300363	博腾股份	300	7,545.00	0.00
736	603279	景津装备	340	7,517.40	0.00
737	688651	盛邦安全	162	7,460.10	0.00
738	600320	振华重工	2,200	7,304.00	0.00
739	600027	华电国际	1,400	7,196.00	0.00
740	688591	泰凌微	254	7,117.08	0.00
741	603809	豪能股份	600	7,110.00	0.00
742	301261	恒工精密	139	7,068.15	0.00
743	603520	司太立	500	7,040.00	0.00
744	688173	希荻微	400	7,036.00	0.00
745	688653	康希通信	439	7,019.61	0.00
746	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
747	000030	富奥股份	1,300	6,942.00	0.00
748	603013	亚普股份	400	6,912.00	0.00
749	002194	武汉凡谷	700	6,902.00	0.00
750	688249	晶合集成	400	6,900.00	0.00
751	688602	康鹏科技	622	6,879.32	0.00
752	300458	全志科技	300	6,807.00	0.00
753	301251	威尔高	196	6,779.64	0.00
754	002056	横店东磁	500	6,770.00	0.00
755	301533	威马农机	202	6,698.32	0.00
756	301272	英华特	125	6,672.50	0.00
757	688610	埃科光电	129	6,579.00	0.00
758	301202	朗威股份	205	6,519.00	0.00
759	002424	贵州百灵	800	6,488.00	0.00
760	688702	盛科通信	134	6,456.12	0.00
761	000090	天健集团	1,400	6,440.00	0.00
762	002838	道恩股份	500	6,405.00	0.00
763	603123	翠微股份	600	6,390.00	0.00
764	600277	亿利洁能	2,400	6,312.00	0.00
765	688345	博力威	200	6,292.00	0.00

766	601615	明阳智能	500	6,270.00	0.00
767	600750	江中药业	300	6,264.00	0.00
768	603882	金域医学	100	6,257.00	0.00
769	301469	恒达新材	189	6,254.01	0.00
770	301486	致尚科技	132	6,237.00	0.00
771	002398	垒知集团	1,300	6,201.00	0.00
772	603324	盛剑环境	200	6,074.00	0.00
773	603187	海容冷链	400	6,064.00	0.00
774	603055	台华新材	500	6,020.00	0.00
775	600770	综艺股份	1,200	5,892.00	0.00
776	000733	振华科技	100	5,884.00	0.00
777	600420	国药现代	600	5,874.00	0.00
778	300699	光威复材	220	5,867.40	0.00
779	301329	信音电子	262	5,824.26	0.00
780	002966	苏州银行	900	5,814.00	0.00
781	301517	陕西华达	132	5,767.08	0.00
782	300593	新雷能	390	5,760.30	0.00
783	300251	光线传媒	700	5,705.00	0.00
784	688648	中邮科技	266	5,700.38	0.00
785	002950	奥美医疗	600	5,688.00	0.00
786	600510	黑牡丹	1,000	5,650.00	0.00
787	300166	东方国信	600	5,640.00	0.00
788	688638	誉辰智能	94	5,609.92	0.00
789	002517	恺英网络	500	5,585.00	0.00
790	301550	斯菱股份	128	5,576.96	0.00
791	000791	甘肃能源	1,000	5,570.00	0.00
792	603100	川仪股份	200	5,544.00	0.00
793	301418	协昌科技	107	5,371.40	0.00
794	603277	银都股份	200	5,364.00	0.00
795	301393	昊帆生物	89	5,283.93	0.00
796	000785	居然之家	1,600	5,280.00	0.00
797	301395	仁信新材	282	5,270.58	0.00
798	301456	盘古智能	170	5,166.30	0.00
799	688646	逸飞激光	142	5,121.94	0.00
800	301528	多浦乐	73	5,030.43	0.00
801	002218	拓日新能	1,100	4,961.00	0.00
802	002626	金达威	300	4,899.00	0.00
803	002153	石基信息	500	4,870.00	0.00
804	000719	中原传媒	500	4,865.00	0.00
805	002219	新里程	1,600	4,848.00	0.00
806	002025	航天电器	100	4,802.00	0.00



807	300510	金冠股份	800	4,776.00	0.00
808	002610	爱康科技	2,200	4,752.00	0.00
809	000967	盈峰环境	1,000	4,750.00	0.00
810	688719	爱科赛博	78	4,687.80	0.00
811	603004	鼎龙科技	147	4,584.93	0.00
812	603589	口子窖	100	4,530.00	0.00
813	000959	首钢股份	1,300	4,498.00	0.00
814	301525	儒竞科技	55	4,480.30	0.00
815	301515	港通医疗	158	4,466.66	0.00
816	002155	湖南黄金	400	4,456.00	0.00
817	002284	亚太股份	500	4,385.00	0.00
818	600867	通化东宝	400	4,332.00	0.00
819	002545	东方铁塔	600	4,290.00	0.00
820	300613	富瀚微	100	4,244.00	0.00
821	300113	顺网科技	300	4,200.00	0.00
822	000031	大悦城	1,400	4,158.00	0.00
823	002215	诺普信	500	4,130.00	0.00
824	000921	海信家电	200	4,080.00	0.00
825	301219	腾远钴业	100	3,937.00	0.00
826	002739	万达电影	300	3,906.00	0.00
827	301500	飞南资源	185	3,864.65	0.00
828	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
829	002020	京新药业	300	3,816.00	0.00
830	002993	奥海科技	100	3,810.00	0.00
831	603611	诺力股份	200	3,786.00	0.00
832	301200	大族数控	100	3,777.00	0.00
833	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
834	301520	万邦医药	71	3,744.54	0.00
835	600282	南钢股份	1,000	3,700.00	0.00
836	000881	中广核技	500	3,625.00	0.00
837	301180	万祥科技	200	3,618.00	0.00
838	001330	博纳影业	500	3,600.00	0.00
839	688238	和元生物	400	3,596.00	0.00
840	300404	博济医药	400	3,580.00	0.00
841	002697	红旗连锁	700	3,486.00	0.00
842	002456	欧菲光	400	3,484.00	0.00
843	603186	华正新材	100	3,470.00	0.00
844	600172	黄河旋风	900	3,366.00	0.00
845	300409	道氏技术	300	3,342.00	0.00
846	300818	耐普矿机	100	3,301.00	0.00
847	605305	中际联合	100	3,231.00	0.00

848	300384	三联虹普	200	3,192.00	0.00
849	002832	比音勒芬	100	3,170.00	0.00
850	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
851	600378	昊华科技	100	3,048.00	0.00
852	605336	帅丰电器	200	2,976.00	0.00
853	600478	科力远	600	2,952.00	0.00
854	002550	千红制药	500	2,940.00	0.00
855	002815	崇达技术	300	2,874.00	0.00
856	001306	夏厦精密	38	2,863.68	0.00
857	300618	寒锐钴业	100	2,829.00	0.00
858	002291	遥望科技	300	2,814.00	0.00
859	002293	罗莱生活	300	2,787.00	0.00
860	603231	索宝蛋白	129	2,777.37	0.00
861	301060	兰卫医学	200	2,658.00	0.00
862	601012	隆基绿能	116	2,656.40	0.00
863	600775	南京熊猫	200	2,650.00	0.00
864	000913	钱江摩托	200	2,494.00	0.00
865	600655	豫园股份	400	2,484.00	0.00
866	002539	云图控股	300	2,475.00	0.00
867	603169	兰石重装	400	2,464.00	0.00
868	601606	长城军工	200	2,436.00	0.00
869	300455	航天智装	200	2,388.00	0.00
870	301217	铜冠铜箔	200	2,372.00	0.00
871	000415	渤海租赁	1,100	2,354.00	0.00
872	002214	大立科技	200	2,294.00	0.00
873	603330	天洋新材	300	2,274.00	0.00
874	600776	东方通信	200	2,258.00	0.00
875	600012	皖通高速	200	2,204.00	0.00
876	600163	中闽能源	500	2,185.00	0.00
877	603193	润本股份	130	2,165.80	0.00
878	300027	华谊兄弟	800	2,144.00	0.00
879	603275	众辰科技	53	2,104.10	0.00
880	603107	上海汽配	113	2,055.47	0.00
881	601636	旗滨集团	300	2,052.00	0.00
882	601952	苏垦农发	200	2,048.00	0.00
883	603062	麦加芯彩	35	2,023.35	0.00
884	603855	华荣股份	100	1,996.00	0.00
885	603276	恒兴新材	79	1,965.52	0.00
886	605060	联德股份	100	1,870.00	0.00
887	600596	新安股份	200	1,824.00	0.00
888	600449	宁夏建材	100	1,793.00	0.00

889	002446	盛路通信	200	1,660.00	0.00
890	002006	精工科技	100	1,528.00	0.00
891	002261	拓维信息	100	1,504.00	0.00
892	002434	万里扬	200	1,490.00	0.00
893	300768	迪普科技	100	1,478.00	0.00
894	600688	上海石化	500	1,430.00	0.00
895	603699	纽威股份	100	1,386.00	0.00
896	002534	西子洁能	100	1,249.00	0.00
897	000767	晋控电力	400	1,204.00	0.00
898	603901	永创智能	100	1,190.00	0.00
899	000928	中钢国际	200	1,166.00	0.00
900	300077	国民技术	100	1,129.00	0.00
901	600874	创业环保	200	1,110.00	0.00
902	002237	恒邦股份	100	1,078.00	0.00
903	603718	海利生物	100	1,071.00	0.00
904	000927	中国铁物	400	1,068.00	0.00
905	002038	双鹭药业	100	1,019.00	0.00
906	605268	王力安防	100	974.00	0.00
907	002163	海南发展	100	908.00	0.00
908	002145	中核钛白	200	896.00	0.00
909	601015	陕西黑猫	200	896.00	0.00
910	000016	深康佳A	200	834.00	0.00
911	300821	东岳硅材	100	830.00	0.00
912	000718	苏宁环球	300	777.00	0.00
913	002614	奥佳华	100	750.00	0.00
914	000517	荣安地产	300	735.00	0.00
915	601330	绿色动力	100	664.00	0.00
916	000061	农产品	100	647.00	0.00
917	002320	海峡股份	100	583.00	0.00
918	002419	天虹股份	100	553.00	0.00
919	600925	苏能股份	100	551.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	10,978,740.00	1.19
2	000725	京东方 A	6,544,225.00	0.71
3	000333	美的集团	6,172,360.58	0.67
4	601319	中国人保	5,986,453.00	0.65

5	600406	国电南瑞	5,818,208.00	0.63
6	002475	立讯精密	5,281,129.00	0.57
7	600050	中国联通	5,165,659.00	0.56
8	600809	山西汾酒	5,031,462.00	0.55
9	300750	宁德时代	4,951,812.00	0.54
10	000651	格力电器	4,901,160.00	0.53
11	600276	恒瑞医药	4,889,606.80	0.53
12	603993	洛阳钼业	4,852,766.00	0.53
13	601766	中国中车	4,831,608.00	0.52
14	300059	东方财富	4,783,332.80	0.52
15	601318	中国平安	4,720,542.00	0.51
16	000858	五粮液	4,663,501.00	0.51
17	002049	紫光国微	4,403,776.00	0.48
18	601328	交通银行	4,384,554.00	0.48
19	601398	工商银行	4,168,256.00	0.45
20	300124	汇川技术	4,085,622.00	0.44

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	27,954,497.00	3.04
2	002594	比亚迪	13,355,388.24	1.45
3	300750	宁德时代	13,159,815.00	1.43
4	601318	中国平安	12,962,109.00	1.41
5	000568	泸州老窖	11,964,564.62	1.30
6	601012	隆基绿能	9,759,198.48	1.06
7	000858	五粮液	9,238,898.50	1.00
8	002304	洋河股份	9,226,358.00	1.00
9	601899	紫金矿业	8,881,163.00	0.96
10	600438	通威股份	8,590,334.00	0.93
11	002129	TCL 中环	8,236,631.00	0.89
12	600276	恒瑞医药	8,230,559.12	0.89
13	000333	美的集团	7,883,138.27	0.86
14	000651	格力电器	7,691,289.00	0.84
15	688981	中芯国际	7,640,120.00	0.83
16	601390	中国中铁	7,385,784.00	0.80
17	600489	中金黄金	7,333,769.00	0.80
18	600050	中国联通	7,176,852.00	0.78

19	601658	邮储银行	7,001,879.00	0.76
20	600919	江苏银行	6,751,889.00	0.73

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	798,200,292.76
卖出股票收入（成交）总额	1,306,445,272.28

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,069,433.42	2.99
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	9,069,433.42	2.99

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019709	23 国债 16	68,000	6,835,583.56	2.26
2	019703	23 国债 10	17,000	1,724,135.34	0.57
3	019694	23 国债 01	5,000	509,714.52	0.17

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

---

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

### 1、对冲策略

现阶段本基金将根据对证券市场走势的判断，适时利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。

原则上本基金绝大多数时间在股票投资策略的基础上，通过构建和股票多头相匹配的股指期货空头头寸，从而对冲本基金的系统性风险，以获取精选股票的绝对收益。

### 2、套利策略

本基金主要采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。同时，本基金根据市场情况的变化，灵活运用其他对冲套利策略提高资本的利用率，从而提高绝对收益，达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。

#### （1）股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

##### ①期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

##### ②跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约价差进行获利。

#### （2）其他套利策略

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他套利策略。

### 3、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股

---

指期货、国债期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

## **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、国债期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

### **8.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

## **8.12 市场中性策略执行情况**

截至本报告期末，本基金持有股票资产 232,309,141.26 元，占基金资产净值的比例为 76.69%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 219,406,620.00 元，占基金资产净值的比例为 72.43%，空头合约市值占股票资产的比例为 94.45%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 1,241,270.00 元，公允价值变动损益为 15,147,575.00 元。

## **8.13 投资组合报告附注**

### **8.13.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在报告期内曾被中国银行间市场交易商协会立案调查。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### **8.13.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	26,368,857.44
2	应收清算款	151,071.28
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	459,653.73
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	26,979,582.45

### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合A	1,134	104,224.95	95,940,941.55	81.17	22,250,153.74	18.83
富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合	771	209,892.25	145,654,329.41	90.01	16,172,595.20	9.99



C						
富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合E	1	914.41	914.41	100.00	—	—
合计	1,906	146,914.45	241,596,185.37	86.28	38,422,748.94	13.72

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合A	754,917.43	0.6387
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合C	12,179.45	0.0075
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合E	—	—
	合计	767,096.88	0.2739

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合A	0
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合C	0
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合A	10~50

	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	0
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E	0
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E
基金合同生效日(2020年02月25日)基金份额总额	1,771,147,316.27	1,219,666,060.43	—
报告期期初基金份额总额	539,900,769.02	351,578,532.92	—
本报告期基金总申购份额	50,043,220.27	150,070,777.07	914.41
减：本报告期基金总赎回份额	471,752,894.00	339,822,385.38	—
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	—	—	—
报告期期末基金份额总额	118,191,095.29	161,826,924.61	914.41

注：本基金自2023年12月21日起增加E类份额，相关数据按实际存续期计算。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2023年11月23日发布公告，李强先生自2023年11月22日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 4.3 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 21 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	44,351,009.46	2.12	32,453.99	2.14	—
诚通证券	2	63,359,907.94	3.02	45,701.30	3.01	—
东方证券	2	76,791,001.69	3.67	55,975.23	3.69	—
东吴证券	2	345,471,668.61	16.49	250,540.83	16.52	—
方正证券	1	145,509.42	0.01	107.08	0.01	—
广发证券	2	69,998,939.39	3.34	51,078.80	3.37	—
国盛证券	2	142,226,291.27	6.79	102,588.52	6.76	—
海通证券	2	123,877,545.19	5.91	90,160.57	5.94	—
华泰证券	2	188,945,917.83	9.02	136,408.12	8.99	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	3	407,082,923.59	19.43	294,358.93	19.40	—
申港证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	34,936,329.21	1.67	25,424.93	1.68	—

太平洋证券	2	226,224,210.97	10.80	163,475.96	10.78	—
银河证券	2	267,314,821.73	12.76	193,476.04	12.75	—
浙商证券	2	60,504,103.18	2.89	43,639.87	2.88	—
中金公司	2	33,503,677.18	1.60	24,167.96	1.59	—
中信建投	2	9,637,772.52	0.46	7,091.67	0.47	—
中信证券	2	528,593.25	0.03	381.28	0.03	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	199,960.00	0.60	—	—	—	—
东吴证券	4,418.33	0.01	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	9,887.40	0.03	19,000,000.00	100.00	—	—
国盛证券	498,920.00	1.50	—	—	—	—
海通证券	7,520,826.75	22.60	—	—	—	—
华泰证券	4,668,438.22	14.03	—	—	—	—
华西证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	13,575,050.12	40.80	—	—	—	—
申港证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	6,776,132.00	20.36	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	21,031.42	0.06	—	—	—	—

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年02月02日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年03月25日
3	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金开通定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2023年03月30日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年05月04日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年08月09日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年08月24日
7	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年10月10日
8	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年11月22日
9	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2023年11月23日
10	关于富国量化对冲策略三个月持	规定披露媒介	2023年12月19日

	有期灵活配置混合型证券投资基金暂停通过直销渠道对本基金 C 类份额的申购、转换转入及定期定额投资业务的公告		
11	富国基金管理有限公司关于富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2023 年 12 月 19 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-01-10 至 2023-02-19	—	—	—	—	—
	2	2023-01-01 至 2023-03-30	215,309,976.73	—	215,309,976.73	—	—
	3	2023-04-04 至 2023-04-09	44,626,670.35	—	18,483,422.52	26,143,247.83	9.34%
	4	2023-11-30 至 2023-12-05; 2023-12-19 至 2023-12-31	—	58,264,939.62	—	58,264,939.62	20.81%

#### 产品特有风险

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，经基金管理人董事会七届一次会议审议通过并按规定备案，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。二、本报告期内，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定和《富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2023 年 12 月 21 日起，对本基金增加 E 类基金份额，并对本基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2023 年 12 月 19 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

## § 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金的文件	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。
2、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同		
3、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券		

---

投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		
--------------------------------------	--	--